

Destino: DIRAF / PRESI

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

Data: 16/08/2021

RELATÓRIO Nº. 012/ 2021 – COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **Julho/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 15)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (página 16)
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (página 17 a 18)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (página 19 a 20)
- 8) Rentabilidade do Fundo Previdenciário - Consolidado – FPREV (página 21 a 22)
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro – (páginas 22 a 23)
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 24)
- 11) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 25 a 31)
- 12) Total dos Recursos e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (página 32)
- 13) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 33)
- 14) Relatório de Riscos da Carteira (página 34 a 41)
- 15) Parecer do Comitê de Investimentos (página 42).

1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

Brasil: Inflação tem nova aceleração em julho e cenário segue desafiador.

Mundo: Fed reconhece atividade forte, mas mantém postura paciente com a inflação.

Em julho, a prévia da inflação ao consumidor (IPCA-15) variou 0,72%. A inflação acumulada em 12 meses apresentou nova aceleração, de 8,1% em junho para 8,6% em julho. A principal surpresa altista ocorreu em Transportes, com aceleração mais intensa do que o esperado (1,07% ante 0,7%). Nesse componente, Passagem Aérea avançou 35,6%. Em relação aos demais componentes, destaque para a alta acima do esperado em Despesas Pessoais (0,36% ante 0,25%) e Alimentação e Bebidas (0,49% ante 0,41%). Com relação aos núcleos, que são métricas que excluem ou suavizam itens com inflação volátil, a leitura de julho também revelou uma piora no quadro. A média dos núcleos avançou 0,6% e no acumulado em doze meses, o indicador subiu de 4,8% para 5,3%. De modo geral, as leituras mais recentes de inflação confirmam o realinhamento de preços de serviços com a reabertura da economia. A inflação de bens, por sua vez, não sinaliza tendência de desaceleração diante do espaço para repasse do aumento de custos. O cenário inflacionário para os próximos meses, portanto, segue bem pressionado. Os riscos de alta seguem evidentes com o elevado patamar dos preços de commodities, problemas na oferta de produtos in natura, baixos estoques de matérias-primas e reabertura mais rápida da economia, pressionando o setor de serviços.

O Índice do Banco Central de atividade (IBC-Br) recuou 0,4% na margem em maio. O indicador prévio do PIB registrou resultado abaixo de nossa expectativa ao mostrar queda mesmo em um mês no qual houve alta das vendas no varejo ampliado (3,8%), da produção industrial (1,4%) e do volume de serviços (1,2%), contrabalançados pela menor produção agrícola. Com o resultado, a média do índice em abril e maio representa queda de 0,2% em relação à média do 1º trimestre. Na comparação interanual, o índice teve alta de 14,2%. O IBCBr passou a se situar 0,2% acima do patamar pré-pandemia (média de janeiro e fevereiro de 2020). Em junho, os dados de atividade devem ser beneficiados por maior montante pago do auxílio emergencial e pelo menor grau de restrições de mobilidade.

Nos EUA, o Fed manteve a taxa de juros entre 0% a.a e 0,25% a.a e reconheceu que a economia segue em recuperação firme. O Banco Central americano reafirmou que manterá o patamar da taxa de juros e o programa de US\$ 120 bilhões mensais em compra de ativos, até avanço substancial em direção ao alcance das metas de pleno emprego e de inflação. No comunicado, o Fed manteve a avaliação que a inflação elevada corrente decorre de eventos transitórios. Na entrevista após a reunião, o presidente do Fed, Jerome Powell, revelou que os membros do comitê de política monetária debateram eventuais estratégias para a redução da compra de ativos. Contudo, uma decisão final será tomada apenas nas



próximas reuniões, uma vez que se obtenha maior clareza sobre a velocidade de recuperação do emprego. Powell reforçou que não existe qualquer perspectiva de alteração da taxa de juros no horizonte. Gradualmente o Fed reconhece os avanços no mercado de trabalho e na inflação, abrindo espaço para o anúncio da redução dos estímulos, esse cenário deverá ocorrer formalmente na reunião de dezembro, com redução efetiva das compras a partir de janeiro.

O Banco Central Europeu (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 total do Programa Pandêmico de Compras Emergenciais (PEPP na sigla em inglês) foi mantido em € 1,85 trilhão em compra de ativos, com horizonte de compras até março de 2022 ou até o BCE julgar que a crise atual tenha se encerrado. Como novidade, essa foi a primeira reunião sob a nova estratégia de política monetária, anunciada há duas semanas. Reconhecendo que as taxas de juros estão no seu limite inferior há algum tempo, enquanto as perspectivas de médio prazo para a inflação ainda estão muito abaixo da meta, o BCE assumiu o compromisso de manter a política monetária persistentemente acomodaticia até alcançar a meta de 2%. Nesse sentido, o comunicado adiciona que o aumento da taxa de juros apenas ocorrerá se o BCE estiver seguro que a meta de inflação será atingida em um horizonte curto. Em suma, a reunião com o mais novo escopo adotado pelo BCE reforça o quadro de manutenção do estímulo monetário por um período prolongado.

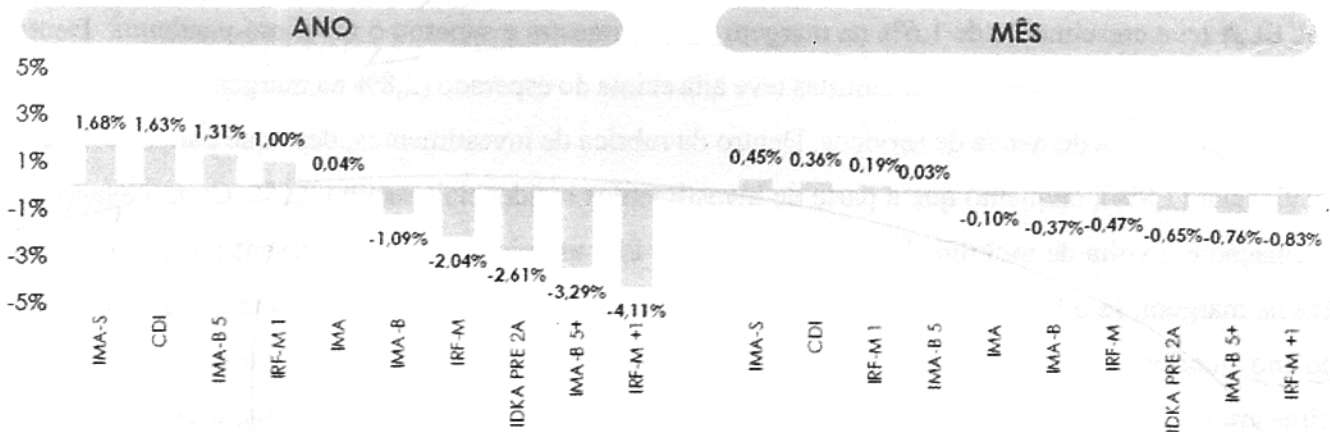
Em relação à atividade econômica, EUA e China tiveram crescimento no 2º trimestre deste ano. O PIB dos EUA teve crescimento de 1,6% na margem no 2º trimestre e superou o nível pré-pandemia. Dentre seus componentes, o consumo das famílias teve alta acima do esperado (2,8% na margem), com destaque para a expansão da demanda de serviços. Dentro da rubrica de investimentos, destaque para a parte não-residencial (1,9%), enquanto que a parte de investimentos residenciais recuou 2,5%. Com o avanço da vacinação e a volta da mobilidade, no 3º trimestre o PIB americano deverá apresentar crescimento de 2% na margem. Já o PIB da China avançou 7,9% no 2º trimestre na comparação com o mesmo período do ano anterior. A série com ajuste sazonal, que compara o momento atual da economia com o primeiro trimestre de 2021, mostra tendência de alta do crescimento: em termos anualizados, o crescimento na margem foi de 6%, frente ao avanço de 5% no 1º trimestre. O desempenho no trimestre contou com avanço acima do esperado dos indicadores de atividade em junho, após dois meses de frustração. Destaque para o consumo e pelo investimento liderado pela indústria privada. Em nossa avaliação, os dados revelam trajetória consistente de expansão do PIB de cerca de 8% em 2021, e afastam o temor de uma desaceleração pronunciada no segundo semestre. Nesse sentido, avalia-se que o recente corte da taxa de depósito compulsório em 0,5 p.p pelo banco central mantém relação com problemas pontuais de liquidez ao invés de um problema estrutural de crescimento.



Relatório de Investimentos – Julho/2021

Perspectivas Renda Fixa – A recuperação econômica segue forte pelo mundo, entretanto uma nova variante de COVID-19 traz incertezas com relação a possíveis impactos na atividade, mas o impacto tende a ser baixo. Os auxílios emergenciais nos EUA terão fim em setembro e, com isso, uma possível volta do emprego é esperada. A inflação segue alta e um fator que chama bastante a atenção nesse ambiente é a existência de gargalos na indústria que têm dificultado o ajuste de preços em outros setores. Apesar deste cenário, as taxas de juros americanas seguem em queda, indicando uma maior busca por segurança, somado a isso o banco central ainda aguarda mais dados de inflação e atividade para agir. No cenário local seguimos com uma recuperação forte da atividade, entretanto cresce a incerteza gerada pelo cenário de maior inflação que é puxada por bens industriais, alimentos e preços administrados. O câmbio e o petróleo seguem como fatores de pressão inflacionária para frente, devido as eleições e a recuperação forte do mundo com baixa produção de petróleo respectivamente. Por sua vez, o Banco Central tem se esforçado para conter o avanço inflacionário, através de uma condução de política monetária mais apertada. No cenário da BRAM, a gestão segue acreditando em um crescimento da economia próximo ao seu potencial e, por este motivo, será necessária uma elevação superior de juros. Assim, a expectativa da gestão é de uma Selic por volta de 7,5% no final de 2021. Fonte: Carta do Gestor emitido pela BRAM Asset Management

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA FIXA



Fonte: Carta ao Gestor_BRAM - Agosto/2021

Perspectivas Renda Variável – Em julho, a bolsa dos EUA foi o destaque positivo, refletindo o otimismo com a economia americana e taxas de juros futuros mais comportadas. Por outro lado, as bolsas dos países em desenvolvimento tiveram perdas motivadas pelas preocupações com a variante delta do COVID-19 e questões relacionadas a intervenções e regulação pelo governo chinês, afetando empresas dos setores de educação, tecnologia e commodities metálicas. O S&P 500 teve retorno de +2,27% e o

MSCI Emerging Markets -7,28. Estes índices acumulam retorno no ano de +17,02% e -1,04%, respectivamente e em moeda original.

No Brasil, as ações tiveram comportamento negativo, motivado pelo aumento das preocupações em torno do risco fiscal e noticiário político. As pequenas e médias empresas tiveram performance negativa e abaixo Ibovespa. O Ibovespa teve retorno de -3,94%, mantendo alta de 2,34% no ano.

O fluxo do investidor estrangeiro sofreu reversão em julho, mas continua bastante positivo no ano. O mercado local segue aquecido e o recorde de IPOs ajuda a ilustrar essa visão. A gestão segue com visão positiva para renda variável no médio e longo prazos, onde pode-se destacar fatores como crescimento cíclico do PIB e juros em patamares baixos considerando a normalização da Selic anunciada pelo BC, trazendo fluxo do investidor local para a bolsa. Risco político, inflação e risco fiscal permanecem como pontos de atenção. 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 se tem pela frente.

Sobre a performance setorial, o mês foi positivo para o setor de Alimentos & Agronegócio, em especial para JBS que se beneficia da combinação entre alta demanda por proteínas na China e receitas em dólares. O setor de Bens de Capital também foi destaque positivo devido a boa performance das ações da Weg que segue bem posicionada para se beneficiar do crescimento global. Do lado negativo, estão setores com baixa atratividade no momento, seja pelo ambiente de aversão a risco, seja pela alta das taxas de juros futuros locais, como Educação, Construção Civil e Serviços Financeiros.

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA VARIÁVEL

	JULHO	2021	12 MESES	24 MESES	36 MESES
S&P 500 USD	2,27%	17,02%	34,37%	47,47%	56,07%
MSCI WORLD USD	1,72%	14,10%	33,16%	40,30%	42,55%
SMLL CAPS	-5,80%	4,96%	20,13%	29,57%	86,53%
IBRX100	-3,99%	4,47%	20,73%	23,34%	61,40%
IDIV	-1,72%	0,31%	14,21%	18,21%	67,31%
IBOVESPA	-3,94%	2,34%	18,35%	19,63%	53,75%

Fonte: Carta ao Gestor BRAM - Agosto/2021.



Relatório de Investimentos – Julho/2021

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

2.1 SALDOS E PERFORMANCE RENDA FIXA

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/06/2021	30/07/2021	mai/21	jun/21	jul/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 327.040.251,85	R\$ 324.169.581,13	0,4808	0,1114	(0,2496)	0,3417%	-0,9290%	0,5452%	
BB PREVID TP VII	R\$ 7.021.922,22	R\$ 7.067.965,92	0,7469	0,3499	0,6557	1,7623%	2,8560%	6,5324%	
BB PREVID IDKA 2	R\$ 291.362.716,67	R\$ 291.605.886,89	0,6709	(0,0935)	0,0834	0,6607%	1,5025%	5,6144%	
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ -	R\$ 10.737.084,45	-	-	0,3900	0,3900%	1,8400%	2,5500%	
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 3.839.020,80	R\$ 3.851.783,18	0,2700	0,3000	0,3700	0,9429%	1,5400%	1,9200%	
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 53.486.644,54	R\$ 53.387.750,60	0,5300	(0,3300)	(0,1800)	0,0179%	-2,4500%	2,7700%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 487.037.431,15	R\$ 487.102.355,11	0,6694	(0,1400)	0,0139	0,5424%	1,1685%	4,7676%	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 532.420.835,04	R\$ 528.291.268,67	0,2387	(0,0030)	(0,7756)	-0,5417%	-0,0639%	0,8978%	
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 28.485.202,04	R\$ 28.503.585,37	0,8100	0,2200	0,0600	1,0924%	2,5000%	6,8500%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 110.017.589,71	R\$ 109.973.091,36	0,6500	(0,1500)	(0,0400)	0,4588%	1,0400%	4,4900%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 71.694.943,01	R\$ 84.472.535,27	1,3500	0,8200	(0,8100)	1,3534%	-3,5000%	-0,0100%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 21.287,40	R\$ 21.320,58	0,2700	0,2900	0,1600	0,7217%	1,1600%	1,1900%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 38.960.470,37	R\$ 52.131.708,44	1,3200	0,4400	(0,5800)	1,1756%	-2,5800%	0,5200%	
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 1.951.388.314,80	R\$ 1.981.315.916,97							

Quadro 1.

2.2 SALDOS E PERFORMANCE RENDA VARIÁVEL

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/06/2021	30/07/2021	mai/21	jun/21	jul/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 111.709.890,26	R\$ 109.119.630,83	5,6893	(0,7741)	(2,3187)	2,4395%	2,1002%	24,1515%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 192.669.862,29	R\$ 186.079.016,74	8,3100	0,8900	(3,4200)	5,5368%	9,6600%	17,7400%	
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ -	R\$ -	5,6100	0,6700	(3,7800)	2,2988%	2,9500%	18,6900%	
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 348.964.019,93	R\$ 333.005.194,79	3,6400	1,2878	(4,7500)	-0,0116%	-0,3100%	8,2500%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FI AÇÕES	R\$ 10.095.244,17	R\$ 9.697.343,66	2,9300	(0,0382)	(3,9400)	-1,1632%	-1,1200%	NC	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 6.673.983,04	R\$ 8.700.271,36	(0,5400)	(0,5260)	(4,4200)	-5,4362%	14,5462%	NC	
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 35.679.507,55	R\$ 33.781.065,63	6,3615	0,5100	(5,3208)	1,2158%	-2,7658%	1,4853%	
ICATU VANGUARDIA DIVIDENDOS FIA	R\$ 140.917.678,11	R\$ 133.992.708,69	5,2600	(0,6300)	(4,9100)	-0,5388%	-1,8100%	6,5800%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 193.329.777,63	R\$ 187.382.224,65	7,6700	(0,2100)	(3,0800)	4,1346%	8,7700%	23,7400%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBO VESPA	R\$ 43.379.484,68	R\$ 41.407.149,99	5,1100	0,5800	(4,5500)	0,9094%	1,2400%	14,3300%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ -	R\$ -	8,0200	-	-	8,0200%	8,3800%	33,8782%	
ITAU SMALL CAPS VALUATION	R\$ 132.579.095,03	R\$ 126.307.120,79	4,7500	1,1900	(4,7300)	0,9829%	9,0300%	25,1300%	
ITAÚ MM SP500 BRL FIC	R\$ 95.935.261,62	R\$ 98.407.409,24	0,3900	2,6800	2,5800	5,7399%	19,1200%	NC	
SANTANDER CRESCE SENIOR (TOP AÇÕES)	R\$ 15.929,19	R\$ 15.269,75	6,0753	1,0303	(4,1373)	2,7343%	-1,6400%	9,9100%	
SANTANDER SEL CRESCIMENTO (SELEÇÃO 30)	R\$ 50.118.024,34	R\$ -	6,0754	1,0297	(4,1397)	2,7312%	-1,6000%	9,9500%	
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 25.083.798,67	R\$ 25.731.786,58	0,4200	2,6900	2,5800	5,7818%	18,7800%	34,5700%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 95.977.480,58	R\$ 91.722.177,49	4,6800	1,6200	(4,4300)	1,6634%	8,2700%	15,3800%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 138.172.205,58	R\$ 132.484.654,00	4,3800	(0,4800)	(4,1200)	-0,4008%	0,3100%	13,5500%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 35.530.813,06	R\$ 34.350.025,33	6,6175	1,3964	(3,3233)	4,5136%	2,0600%	7,9300%	
BRASIL CAPITAL RP INSTIT FIC AÇÕES	R\$ 29.679.455,16	R\$ 52.509.665,05	0,9200	2,3200	(2,6600)	0,5146%	-1,0200%	NC	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 10.213.459,72	R\$ 9.735.635,99	0,4599	1,0300	(4,6784)	-3,2537%	-3,2537%	NC	
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 93.450.092,45	R\$ 113.054.982,71	-	(0,4300)	(4,1100)	-4,5223%	0,9100%	NC	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 10.805.858,17	R\$ -	5,9800	0,8100	(3,7700)	2,8106%	2,5800%	NC	
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.800.980.921,23	R\$ 1.727.483.333,27							

Quadro 2.

2.3 SALDOS E PERFORMANCE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)					
	30/06/2021	30/07/2021		mai/21	jun/21	jul/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 21.427.728,61	R\$ 22.874.479,24		(2,0071)	(4,6145)	6,7517	-0,2181%	16,5258%	38,6361%
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 133.940.637,57	R\$ 140.903.141,13		(3,5129)	(2,8238)	5,1982	-1,3636%	12,9700%	32,3800%
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 27.425.874,78	R\$ 29.165.061,22		(1,7200)	(3,7200)	6,3400	0,6231%	16,2500%	29,5100%
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 136.629.325,85	R\$ 143.917.898,04		(2,6308)	(2,2458)	5,3345	0,2600%	14,2994%	29,4782%
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 134.738.017,61	R\$ 143.111.291,79		(3,4100)	(0,2100)	6,2100	2,3728%	17,3700%	34,4700%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 33.716.359,34	R\$ 35.983.949,74		(3,2268)	(0,0009)	6,7255	3,2807%	6,0953%	NC
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 34.609.268,58	R\$ 35.232.831,22		(6,9007)	8,3783	1,8017	2,7173%	1,7781%	NC
TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	R\$ 522.487.212,34	R\$ 551.188.652,38							
TOTAL GERAL	R\$ 4.274.856.448,37	R\$ 4.259.987.902,62							

Quadro 3.

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

Nota 2: As movimentações nesse mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. 176/21: a) Novos Recursos: Ratear entre os fundos SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF (30.659.168/0001-74) e ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF (10.756.541/0001-06).

Nota 3: Com base na Ata COMIV nº. 175/21, a Diretoria aprovou a sugestão de zerar aplicação no fundo Santander Seleção Crescimento cujo saldo foi rateado entre os fundos Vinci Mosaico Institucional FIA e Brasil Capital RP Inst FIC Ações.

Nota 4: Com base na Ata de Reunião Extraordinária foi aprovada, em maio/21, zerar posição no fundo Vinci Selection Equities FIA, devido a necessidade de regularização de Credenciamento junto à Amazonprev, o recurso foi aplicado no fundo Bradesco DI Premium.

2.4 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

INSTITUIÇÃO	mai/21	jun/21	jul/21
BRANDESCO	R\$ 259.961.452,10	R\$ 196.508.883,09	R\$ 200.667.884,37
BANCO DO BRASIL	R\$ 805.501.119,97	R\$ 895.191.835,46	R\$ 898.755.442,05
CAIXA	R\$ 1.109.361.707,79	R\$ 1.108.624.418,28	R\$ 1.102.562.440,01
ITAÚ	R\$ 401.420.539,93	R\$ 465.244.906,36	R\$ 453.525.225,25
SANTANDER	R\$ 187.455.828,25	R\$ 184.074.591,10	R\$ 140.918.410,88
ICATU	R\$ 390.924.115,48	R\$ 351.115.412,87	R\$ 356.941.920,69
SAFRA	R\$ 188.510.042,73	R\$ 198.782.286,65	R\$ 220.974.786,81
BTG PACTUAL	R\$ 361.335.416,71	R\$ 365.733.247,14	R\$ 351.402.809,81
AZ QUEST	R\$ 94.449.442,15	R\$ 95.977.480,58	R\$ 91.722.177,49
OCCAM BRASIL	R\$ 138.838.757,78	R\$ 138.172.205,58	R\$ 132.484.654,00
SCHRODER	R\$ 28.486.055,03	R\$ 27.425.874,78	R\$ 29.165.061,22
SULAMÉRICA	R\$ 35.041.502,84	R\$ 35.530.813,06	R\$ 34.350.025,33
PLURAL INVEST	R\$ 66.350.827,49	R\$ 68.325.627,92	R\$ 71.216.780,96
BRASIL CAPITAL	R\$ 9.969.388,59	R\$ 29.679.455,16	R\$ 52.509.665,05
BNP PARIBAS	R\$ 10.045.992,02	R\$ 10.213.459,72	R\$ 9.735.635,99
VINCI PARTNERS	R\$ 10.718.537,20	R\$ 104.255.950,62	R\$ 113.054.982,71
TOTAL	R\$ 4.098.370.726,06	R\$ 4.274.856.448,37	R\$ 4.259.987.902,62

Quadro 4.

Relatório de Investimentos – Julho/2021

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXEC JULHO/2021

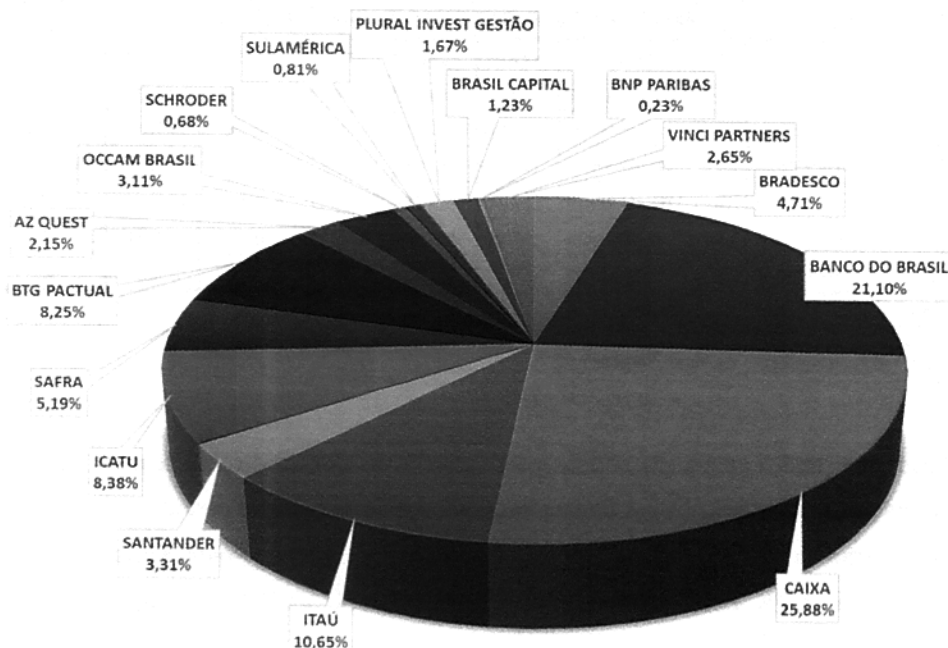


Gráfico 1.

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/06/2021	30/07/2021	mai/21	jun/21	jul/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 167.502.859,45	R\$ 169.998.036,04	1,3590	1,0574	1,4896	3,957%	8,6698%	16,0575%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 174.723.394,08	R\$ 177.342.747,23	1,3684	1,0668	1,4991	3,986%	8,7411%	16,1881%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 179.447.588,15	R\$ 182.180.452,43	1,3922	1,0905	1,5229	4,059%	8,9197%	16,5152%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 181.304.539,61	R\$ 184.022.582,29	1,3685	1,0669	1,4992	3,986%	8,7413%	16,1883%
TOTAL GERAL	R\$ 702.978.381,29	R\$ 713.543.818,00						

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	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\$ 169.998.036,04	R\$ 177.342.747,23	R\$ 182.180.452,43	R\$ 184.022.582,29
DATA DE EMISSÃO	15/01/2014	10/02/2010	10/02/2010	10/02/2010
DATA DA APLICAÇÃO	15/01/2014	15/01/2014	29/01/2014	15/01/2014
DATA DO RESGATE	15/05/2023	15/08/2030	15/08/2030	15/08/2040
TAXA DE JUROS CONTRATADA	6,48%	6,5998%	6,90%	6,60%

Quadro 6.

2.7 ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

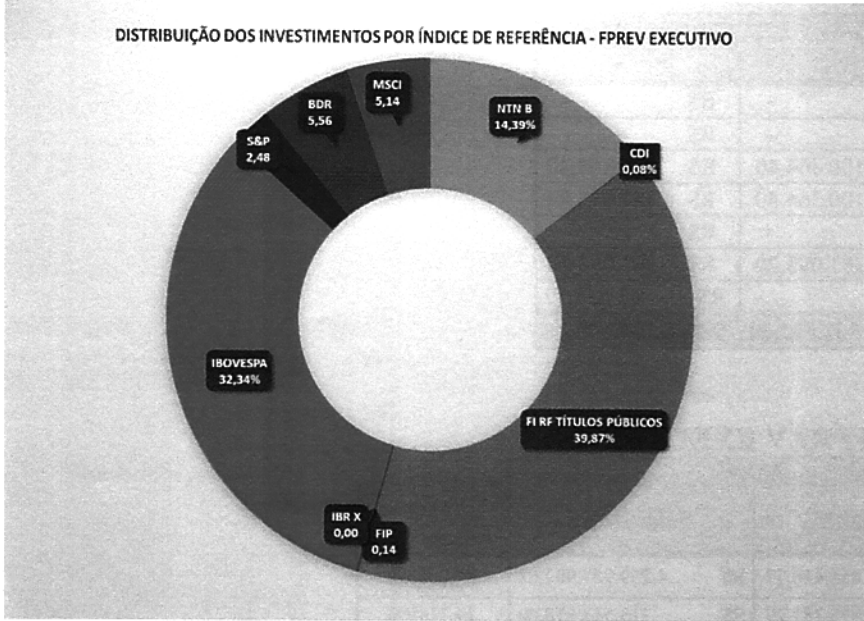


Gráfico 2.

2.8 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	30/06/2021	30/07/2021
CVS - A	R\$ 1.152.732,86	R\$ 1.135.279,54
CVS - B	R\$ 7.458.135,70	R\$ 7.345.157,90
CVS - C	R\$ 149.534,84	R\$ 147.270,76
CVS - D	R\$ 817.883,88	R\$ 805.494,36
TOTAL	R\$ 9.578.287,28	R\$ 9.433.202,56

Quadro 7.

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

2.9 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/21	R\$ 30.247,09	R\$ 145.084,72	R\$ 175.331,81
fev/21	R\$ 29.827,12	R\$ 145.084,72	R\$ 174.911,84
mar/21	R\$ 29.407,16	R\$ 145.084,72	R\$ 174.491,88
abr/21	R\$ 28.978,18	R\$ 145.084,72	R\$ 174.062,90
mai/21	R\$ 28.567,21	R\$ 145.084,72	R\$ 173.651,93
jun/21	R\$ 28.147,25	R\$ 145.084,72	R\$ 173.231,97
jul/21	R\$ 27.727,27	R\$ 145.084,72	R\$ 172.811,99
TOTAL	R\$ 202.901,28	R\$ 1.015.593,04	R\$ 1.218.494,32

Quadro 8.

Handwritten signatures and initials, including a large signature on the left and several smaller ones on the right.

Relatório de Investimentos – Julho/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\$ -	R\$ -	R\$ -	
mar/21	R\$ -	R\$ 100.364,40	R\$ 100.364,40	
abr/21	R\$ 87.271,44	R\$ 100.364,40	R\$ 187.635,84	
mai/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -	
jun/21	R\$ -	R\$ 301.093,20	R\$ 301.093,20	
jul/21	R\$ 43.635,72	R\$ -	R\$ 43.635,72	
TOTAL	R\$ 130.907,16	R\$ 501.822,00	R\$ 632.729,16	

Quadro 9.

2.11 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	30/06/2021	30/07/2021	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.274.856.448,37	R\$ 4.259.987.902,62	84,2683%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 702.978.381,29	R\$ 713.543.818,00	14,1149%
TÍTULOS CVS	R\$ 9.578.287,28	R\$ 9.433.202,56	0,1866%
IMÓVEIS	R\$ 61.835.325,18	R\$ 61.835.325,18	1,2232%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 10.466.516,40	0,2070%
TOTAL	R\$ 5.049.248.442,12	R\$ 5.055.266.764,76	100,00%

Quadro 10.

2.12 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
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\$ 4.764.067.642,49	2,35%	-0,91%	1,67%
abr/21	R\$ 4.868.735.602,27	2,20%	1,26%	2,42%
mai/21	R\$ 4.985.703.862,07	2,40%	3,70%	3,69%
jun/21	R\$ 5.049.248.442,12	1,27%	5,02%	4,38%
jul/21	R\$ 5.055.266.764,76	0,12%	5,14%	3,12%

Quadro 11.

2.13 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

1. Investimentos

Saldo dos Investimentos em 07/2020		RS 4.902.117.066,26	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
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
04/2021	RS 41.308.639,76	RS 10.074.221,86	RS 31.234.417,90
05/2021	RS 41.318.216,48	RS 14.353.928,89	RS 26.964.287,59
06/2021	RS 50.044.250,01	RS 10.611.950,64	RS 39.432.299,37
07/2021	RS 47.181.791,70	RS 9.896.860,10	RS 37.284.931,60
Saldo dos Investimentos em 07/2021		RS 5.055.266.764,76	

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	8,9946 %	4,7617 %	0,9600 %
Juros	5,4500 %	3,1440 %	0,4432 %
Meta	14,9349 %	8,0554 %	1,4075 %
Rentabilidade em %	8,8628 %	3,4976 %	-0,6192 %
Rentabilidade em R\$	RS 410.805.665,71	RS 167.161.198,46	RS -31.266.608,97
Resultado em %	-5,2830 %	-4,2180 %	-1,9986 %
Resultado em R\$	RS -281.702.605,60	RS -217.803.348,60	RS -102.332.592,47

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.

Relatório de Investimentos – Julho/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					
	30/06/2021	30/07/2021	mai/21	jun/21	jul/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 5.224.272,71	R\$ 5.183.752,16	0,2387	(0,0030)	(0,7756)	-0,5417%	-0,0639%	0,8978%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 88.020,10	R\$ 88.157,31	0,2700	0,2900	0,1600	0,7217%	1,1600%	1,1900%
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 1.989.243,71	R\$ 1.990.527,48	0,8100	0,2200	0,0600	1,0924%	2,5000%	6,8500%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 353.482,43	R\$ 353.777,44	0,6709	(0,0935)	0,0800	0,6572%	1,5000%	5,6144%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 7.655.018,95	R\$ 7.616.214,39						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	30/06/2021	30/07/2021	mai/21	jun/21	jul/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 558.182,28	R\$ 530.752,11	5,2600	(0,6300)	(4,9100)	-0,5388%	-1,8100%	6,5800%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 1.681.118,44	R\$ 1.604.237,52	3,6400	1,2878	(4,5700)	0,1773%	-0,3100%	NC
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 528.149,67	R\$ 500.047,79	6,3615	0,5186	(5,3208)	1,2245%	-2,7658%	1,4853%
OCCAM FIC FIA	R\$ 2.242.036,90	R\$ 2.149.748,43	4,3800	(0,4800)	(4,1200)	-0,4008%	0,3100%	13,5500%
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 144.124,66	R\$ 140.283,77	-	2,3200	(2,6600)	-0,4017%	-1,0200%	NC
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ -	R\$ 177.558,42	-	-	2,5800	2,5800%	18,7800%	NC
ITAÚ MM SP500 BRL FIC	R\$ 149.186,78	R\$ 153.031,16	0,3900	2,6800	2,5800	5,7399%	19,1200%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 5.302.798,73	R\$ 5.255.659,20						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	30/06/2021	30/07/2021	mai/21	jun/21	jul/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 1.402.201,46	R\$ 1.489.341,07	(3,4100)	(0,2100)	6,2100	2,3728%	17,3700%	34,4700%
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.402.201,46	R\$ 1.489.341,07						

TOTAL GERAL	R\$ 14.360.019,14	R\$ 14.361.214,66
-------------	-------------------	-------------------

Quadro 13.

Nota: Com base na Ata COMIV nº. 176/2021, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Direcionar para o fundo SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO.

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/06/2021	30/07/2021	mai/21	jun/21	jul/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.389.828,33	R\$ 2.426.223,79	1,3922	1,0905	1,5229	4,0589%	8,9196%	16,5152%
TOTAL GERAL	R\$ 2.389.828,33	R\$ 2.426.223,79						

Quadro 14.

3.3 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	30/06/2021	30/07/2021
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 7.655.018,95	R\$ 7.616.214,39
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 5.302.798,73	R\$ 5.255.659,20
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.402.201,46	R\$ 1.489.341,07
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.389.828,33	R\$ 2.426.223,79
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 16.749.847,47	R\$ 16.787.438,45

Quadro 15.

3.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

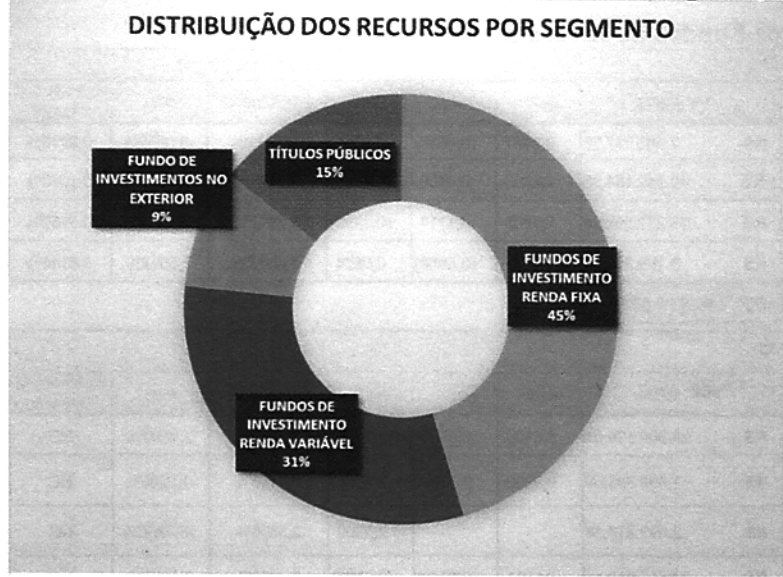


Gráfico 3.

3.5 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

1. Investimentos

Saldo dos Investimentos em 07/2020		RS 13.732.461,93	
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
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
03/2021	RS 143.973,76	RS 0,00	RS 143.973,76
04/2021	RS 144.001,52	RS 0,00	RS 144.001,52
05/2021	RS 144.070,46	RS 0,00	RS 144.070,46
06/2021	RS 144.136,78	RS 0,00	RS 144.136,78
07/2021	RS 174.168,74	RS 0,00	RS 174.168,74
Saldo dos Investimentos em 07/2021		RS 16.787.438,45	

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	8,9946 %	4,7617 %	0,9600 %
Juros	5,4500 %	3,1440 %	0,4432 %
Meta	14,9349 %	8,0554 %	1,4075 %
Rentabilidade em %	7,7346 %	2,8012 %	-0,8154 %
Rentabilidade em RS	RS 1.129.850,22	RS 440.297,50	RS -136.577,76
Resultado em %	-6,2647 %	-4,8625 %	-2,1920 %
Resultado em RS	RS -1.050.241,40	RS -825.497,88	RS -372.324,60

Quadro 16.

(Handwritten signatures and initials)

Relatório de Investimentos – Julho/2021

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

4.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/06/2021	30/07/2021	mai/21	jun/21	jul/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 7.742.812,58	R\$ 7.682.757,72	0,2387	(0,0030)	(0,7756)	-0,5417%	-0,0639%	0,8978%
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 40.373.719,30	R\$ 40.269.184,38	0,4200	0,3300	(0,2000)	0,5499%	-1,0000%	0,1000%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 78.473.482,51	R\$ 78.277.569,54	0,4808	0,1114	(0,2496)	0,3417%	-0,9290%	0,5452%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 3.187.702,60	R\$ 3.190.363,04	0,6719	(0,0900)	0,0834	0,6652%	1,5025%	5,6144%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 129.777.716,99	R\$ 129.419.874,68						

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/06/2021	30/07/2021	mai/21	jun/21	jul/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 29.411.717,28	R\$ 28.300.174,86	5,6100	0,6700	(3,7800)	2,2988%	2,9500%	NC
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.700.719,39	R\$ 1.655.395,60	0,9200	2,3200	(2,6600)	0,5146%	-1,0200%	NC
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ -	R\$ 2.095.810,58	-	-	2,5800	2,5800%	18,7800%	NC
BB AÇÕES VALOR	R\$ 23.050.099,79	R\$ 22.515.628,41	5,6893	(0,7741)	(2,3187)	2,4395%	2,1002%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 54.162.536,46	R\$ 54.567.009,45						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 37.818,92	R\$ 4.595,51
TOTAL RECURSOS	R\$ 183.978.072,37	R\$ 183.991.479,64

Quadro 17.

Nota: Com base na Ata COMIV nº. 176/2021, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Direcionar para o fundo SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO.

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

1. Investimentos

Saldo dos Investimentos em 07/2020	R\$ 158.325.380,30
------------------------------------	--------------------

Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
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\$ 1.642,15	R\$ 1.583.574,91
03/2021	R\$ 1.564.682,30	R\$ 17.772,47	R\$ 1.546.909,83
04/2021	R\$ 1.594.346,58	R\$ 9.707,31	R\$ 1.584.639,27
05/2021	R\$ 1.573.220,64	R\$ 41.257,15	R\$ 1.531.963,49
06/2021	R\$ 1.959.057,05	R\$ 12.521,07	R\$ 1.946.535,98
07/2021	R\$ 2.023.578,91	R\$ 55.617,86	R\$ 1.967.961,05

Saldo dos Investimentos em 07/2021	R\$ 183.991.479,64
------------------------------------	--------------------

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	8,9946%	4,7617%	0,9600%
Juros	5,4500%	3,1440%	0,4432%
Meta	14,9349%	8,0554%	1,4075%
Rentabilidade em %	2,9757%	0,9059%	-1,0436%
Rentabilidade em R\$	R\$ 4.981.111,94	R\$ 1.587.298,97	R\$ -1.919.684,28
Resultado em %	-10,4051%	-6,6165%	-2,4171%
Resultado em R\$	R\$ -19.990.345,33	R\$ -12.521.423,47	R\$ -4.508.605,14

Quadro 18.

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/06/2021	30/07/2021	mai/21	jun/21	jul/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGIA	R\$ 7.902.384,07	R\$ 7.841.091,54	0,2387	(0,0030)	(0,7756)	-0,5417%	-0,0639%	0,8978%
BRADESCO INST. ALOC. DINAMICA	R\$ 8.585.966,91	R\$ 8.568.779,63	0,4200	0,3300	(0,2000)	0,5499%	-1,0000%	0,1000%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 9.470.067,60	R\$ 9.429.494,66	0,6000	(0,1400)	(0,0200)	0,4391%	0,6600%	4,1500%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 2.029.287,68	R\$ 2.030.981,32	0,6709	(0,0935)	0,0834	0,6607%	1,5025%	5,6144%
TOTAL	R\$ 27.987.706,26	R\$ 27.870.347,15						

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/06/2021	30/07/2021	mai/21	jun/21	jul/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.143.577,57	R\$ 1.113.101,48	0,9200	2,3200	(2,6600)	0,5146%	-1,0200%	NC
BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	R\$ 1.069.282,26	R\$ 1.028.871,41	-	0,6700	(3,7800)	-3,1353%	2,9500%	NC
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ -	R\$ 1.108.070,73	-	-	2,5800	2,5800%	18,7800%	NC
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 17.012,75	R\$ 16.107,53	6,3615	0,5100	(5,3208)	1,2158%	-2,7658%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 2.229.872,58	R\$ 3.266.151,15						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$	R\$
	22.799,11	-
TOTAL RECURSOS	R\$ 30.240.377,95	R\$ 31.136.498,30

Quadro 19.

Nota: Com base na Ata COMIV nº. 176/2021, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Direcionar para o fundo SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO.

5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV

1. Investimentos

Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
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
04/2021	R\$ 999.548,81	R\$ 39.463,54	R\$ 960.085,27
05/2021	R\$ 1.057.911,85	R\$ 96.855,31	R\$ 961.056,54
06/2021	R\$ 1.062.228,59	R\$ 51.465,27	R\$ 1.010.763,32
07/2021	R\$ 1.085.187,70	R\$ 51.462,27	R\$ 1.033.725,43
Saldo dos Investimentos em 07/2020			R\$ 18.139.053,30
Saldo dos Investimentos em 07/2021			R\$ 31.136.530,28

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

Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	8,9946 %	4,7617 %	0,9600 %
Juros	5,4500 %	3,1440 %	0,4432 %
Meta	14,9349 %	8,0554 %	1,4075 %
Rentabilidade em %	2,1512 %	0,0770 %	-0,4549 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 515.723,14	R\$ 21.041,44	R\$ -137.573,10
Resultado em %	-11,1225 %	-7,3836 %	-1,8365 %
Resultado em R\$	R\$ -3.046.099,04	R\$ -2.176.278,91	R\$ -563.193,31

Quadro 20.

Relatório de Investimentos – Julho/2021

6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/06/2021	30/07/2021	mai/21	jun/21	jul/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 165.311.630,84	R\$ 164.029.439,57	0,2387	(0,0030)	(0,7756)	-0,5417%	-0,0639%	0,8978%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 51.450.620,68	R\$ 51.322.171,63	0,4808	0,1114	(0,2496)	0,3417%	-0,9290%	0,5452%
BB PREV RF IDKA 2	R\$ 166.021.782,46	R\$ 166.160.343,61	0,6709	(0,0935)	0,0834	0,6607%	1,5025%	5,6144%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 41.784.371,33	R\$ 41.467.572,65	0,6000	(0,1400)	(0,0200)	0,4391%	0,6600%	4,1500%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 424.568.405,31	R\$ 422.979.527,46						
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/06/2021	30/07/2021	mai/21	jun/21	jul/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 10.717.832,59	R\$ 10.147.556,14	6,3615	0,5100	(5,3208)	1,2158%	-2,7658%	NC
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 3.712.158,80	R\$ 3.613.230,59	0,9200	2,3200	(2,6600)	0,5146%	-1,0200%	NC
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ -	R\$ 7.295.360,16	-	-	2,5800	2,5800%	18,7800%	NC
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 5.247.522,09	R\$ 5.049.205,08	5,6100	0,6700	(3,7800)	2,2988%	2,9500%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 19.677.513,48	R\$ 26.105.351,97						
FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/06/2021	30/07/2021	mai/21	jun/21	jul/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 26.106.113,05	R\$ 27.868.737,38	(2,0071)	(4,6145)	6,7517	-0,2181%	16,5258%	NC
TOTAL - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 26.106.113,05	R\$ 27.868.737,38						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 3.631.893,02	R\$ 30.998,82						
TOTAL	R\$ 473.983.924,86	R\$ 476.984.615,63						

Quadro 21.

Nota: Com base na Ata COMIV nº. 176/2021, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Direcionar para o fundo SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO.

6.2 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR SEGMENTO

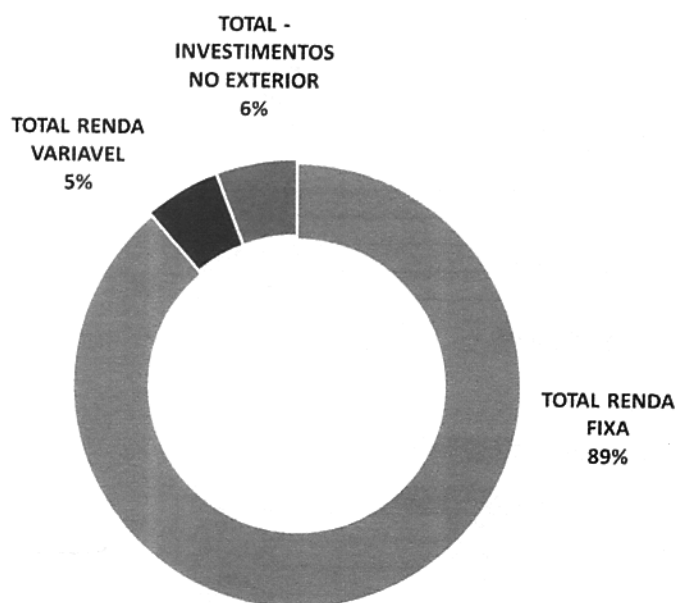


Gráfico 4.

Relatório de Investimentos – Julho/2021

6.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV

1. Investimentos

Saldo dos Investimentos em 07/2020		RS 43.750.152,88	
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
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 284.979,37	RS 3.186.274,07
03/2021	RS 3.427.904,40	RS 367.719,45	RS 3.060.184,95
04/2021	RS 3.574.036,92	RS 317.977,95	RS 3.256.058,97
05/2021	RS 3.591.371,99	RS 308.689,08	RS 3.282.682,91
06/2021	RS 3.620.988,47	RS 346.178,51	RS 3.274.809,96
07/2021	RS 3.670.676,51	RS 315.553,25	RS 3.355.123,26
Saldo dos Investimentos em 07/2021		RS 476.984.615,63	

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	8,9946 %	4,7617 %	0,9600 %	
Juros	5,4500 %	3,1440 %	0,4432 %	
Meta	14,9349 %	8,0554 %	1,4075 %	
Rentabilidade em %	3,8586 %	0,6201 %	-0,0748 %	
Rentabilidade em RS	RS 14.513.442,23	RS 2.858.915,67	RS -354.432,49	
Resultado em %	-9,6369 %	-6,8810 %	-1,4617 %	
Resultado em RS	RS -41.202.929,80	RS -34.271.693,84	RS -7.025.550,81	

Quadro 22.

Handwritten signatures and scribbles, including a large signature at the bottom right and several smaller ones above it.

Relatório de Investimentos – Julho/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 (%)					
	30/06/2021	30/07/2021	mai/21	jun/21	jul/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 42.366.398,54	R\$ 42.037.795,98	0,2387	(0,0030)	(0,7756)	-0,5417%	-0,0639%	0,8978%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 31.051.572,70	R\$ 31.077.488,23	0,6709	(0,0935)	0,0834	0,6607%	1,5025%	5,6144%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 21.362.879,09	R\$ 21.309.545,60	0,4808	0,1114	(0,2496)	0,3417%	-0,9290%	0,5452%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 7.596.396,95	R\$ 7.563.026,52	0,6000	(0,1400)	(0,0200)	0,4391%	0,6600%	4,1500%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 102.377.247,28	R\$ 101.987.856,33						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/06/2021	30/07/2021	mai/21	jun/21	jul/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 10.717.832,59	R\$ 10.147.556,14	6,3615	0,5100	(5,3208)	1,2158%	-2,7658%	NC
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.002.885,01	R\$ 976.158,35	0,9200	2,3200	(2,6600)	0,5146%	-1,0200%	NC
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ -	R\$ 1.041.390,32	-	-	2,5800	2,5800%	18,7800%	NC
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 558.082,74	R\$ 536.991,40	5,6100	0,6700	(3,7800)	2,2988%	2,9500%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 12.278.800,34	R\$ 12.702.096,21						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/06/2021	30/07/2021	mai/21	jun/21	jul/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 499.295,35	R\$ 533.006,62	(2,0071)	(4,6145)	6,7517	-0,2181%	16,5258%	NC
TOTAL - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 499.295,35	R\$ 533.006,62						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 529.022,21	R\$ 7.463,96						
TOTAL	R\$ 115.684.365,18	R\$ 115.230.423,12						

Quadro 23.

Nota: Com base na Ata COMIV nº. 176/2021, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Direcionar para o fundo SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO.

7.2 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR SEGMENTO

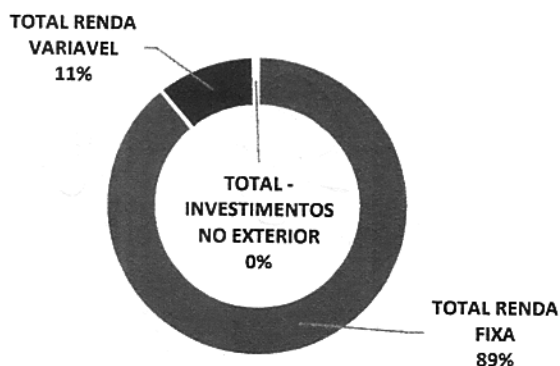


Gráfico 5.

Relatório de Investimentos – Julho/2021

AMAZONPREV
Folha nº 011
[Assinatura]

7.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV

1. Investimentos

Saldo dos Investimentos em 07/2020		RS 7.323.268,29	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
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
03/2021	RS 523.658,87	RS 0,00	RS 523.658,87
04/2021	RS 4.964,70	RS 0,00	RS 4.964,70
05/2021	RS 1.036.389,86	RS 67.687,34	RS 968.702,52
06/2021	RS 521.558,25	RS 32.206,97	RS 489.351,28
07/2021	RS 523.292,11	RS 39.670,93	RS 483.621,18
Saldo dos Investimentos em 07/2021		RS 115.230.423,12	

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	8,9946 %	4,7617 %	0,9600 %
Juros	5,4500 %	3,1440 %	0,4432 %
Meta	14,9349 %	8,0554 %	1,4075 %
Rentabilidade em %	2,8906 %	-0,1498 %	-0,8104 %
Rentabilidade em R\$	RS 2.670.650,99	RS -169.660,59	RS -937.563,24
Resultado em %	-10,4792 %	-7,5935 %	-2,1871 %
Resultado em R\$	RS -11.003.189,71	RS -9.292.906,48	RS -2.565.770,54

Quadro 24.

[Assinaturas manuscritas]

Relatório de Investimentos – Julho/2021

8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV

1. Investimentos

Saldo dos Investimentos em 07/2020		R\$ 5.143.387.382,96	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
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\$ 45.312.469,30	R\$ 2.794.921,30
03/2021	R\$ 48.138.137,76	R\$ 11.102.576,72	R\$ 37.035.561,04
04/2021	R\$ 47.625.538,29	R\$ 10.441.370,66	R\$ 37.184.167,63
05/2021	R\$ 48.721.181,28	R\$ 14.868.417,77	R\$ 33.852.763,51
06/2021	R\$ 57.352.219,15	R\$ 11.054.322,46	R\$ 46.297.896,69
07/2021	R\$ 54.658.695,67	R\$ 10.359.164,41	R\$ 44.299.531,26
Saldo dos Investimentos em 07/2021		R\$ 5.879.395.251,88	

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	8,9946 %	4,7617 %	0,9600 %
Juros	5,4500 %	3,1440 %	0,4432 %
Meta	14,9349 %	8,0554 %	1,4075 %
Rentabilidade em %	8,1883 %	3,0851 %	-0,5921 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 434.614.444,23	R\$ 171.897.091,45	R\$ -34.754.439,84
Resultado em %	-5,8699 %	-4,5998 %	-1,9718 %
Resultado em R\$	R\$ -357.997.410,88	R\$ -276.893.149,18	R\$ -117.370.036,88

Quadro 25.

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

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

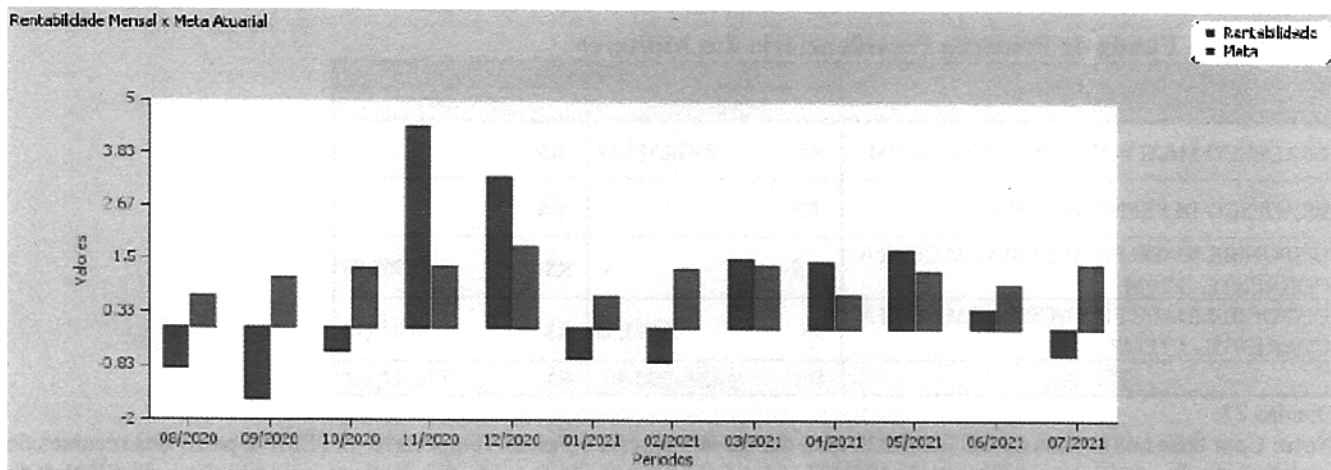


Gráfico 6.

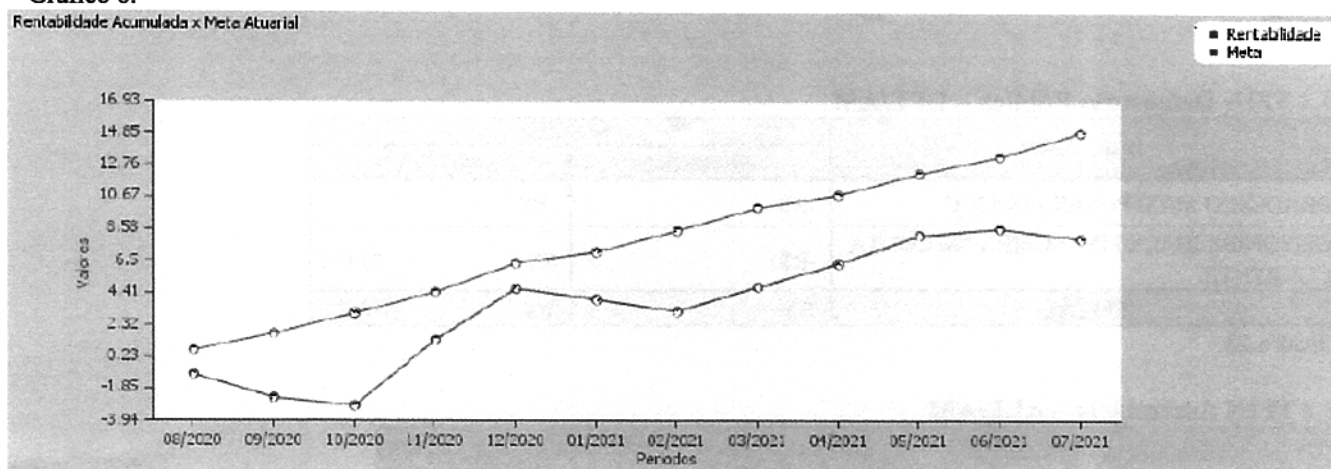


Gráfico 7.

9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/06/2021	30/07/2021
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 13.092.728,63	R\$ 9.980.303,01
FUNDO BRADESCO RF - COMPREV	R\$ 5.674.501,64	R\$ 5.779.948,02
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 10,02	R\$ 0,02
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 13.463.439,05	R\$ 13.496.627,63
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 305.738,62	R\$ 296.144,63
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 52,00
TOTAL	R\$ 32.536.418,96	R\$ 29.553.075,31

Quadro 26.

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

[Assinaturas manuscritas]

Relatório de Investimentos – Julho/2021

9.2 FPPM – Fundo de Proteção Previdenciária dos Militares

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/06/2021	30/07/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R\$ 8.428.311,17	R\$ -
BRADESCO DI PREMIUM - FPPM	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R\$ -	R\$ 27.968,98
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ 9.773,35	R\$ 10.073,15
TOTAL	R\$ 8.438.084,52	R\$ 38.042,13

Quadro 27.

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

9.3 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/06/2021	30/07/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 214,37
TOTAL	R\$ -	R\$ 214,37

Quadro 28.

9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/06/2021	30/07/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 461.530,13	R\$ 431.306,09
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 53.097,56	R\$ 56.909,89
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 514.628,69	R\$ 488.216,98

Quadro 29.

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/06/2021	30/07/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 811.780,77	R\$ 806.993,39
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ 218.481,62	R\$ 214.061,29
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 1.030.262,39	R\$ 1.021.054,68

Quadro 30.

9.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/06/2021	30/07/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 5.027.458,60	R\$ 6.235.542,66
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	R\$ 551.816,14	R\$ 561.329,82
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 5.579.274,74	R\$ 6.796.873,48

Quadro 31.

9.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/06/2021	30/07/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.209.757,74	R\$ 1.205.946,01
DISPONIBILIDADE COBERTURA TCE FFIN	R\$ 872.247,18	R\$ 882.606,72
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 2.082.004,92	R\$ 2.088.552,73

Quadro 32.

10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/06/2021	30/07/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 468.789,63	R\$ 5.058.179,35
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 49.426.630,62	R\$ 49.043.267,43
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 296,99
TOTAL	R\$ 49.895.421,25	R\$ 54.101.743,77

Quadro 33.

10.2 Taxa de Administração - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/06/2021	30/07/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 454.673,43	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 36.125,32
TOTAL	R\$ 454.673,43	R\$ -

Quadro 34.

[Assinaturas manuscritas]

Relatório de Investimentos – Julho/2021

10.3 Taxa de Administração - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/06/2021	30/07/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 65.815,69	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 32.074,46
TOTAL	R\$ 65.815,69	R\$ 32.074,46

Quadro 35.

10.4 Taxa de Administração – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/06/2021	30/07/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 60.850,25	R\$ 153.335,32
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ -
TOTAL	R\$ 60.851,25	R\$ 153.335,32

Quadro 36.

10.5 Taxa de Administração – PGJ/MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/06/2021	30/07/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 156.735,63	R\$ 72.180,99
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 156.735,63	R\$ 72.180,99

TOTAL GERAL	R\$ 50.633.497,25	R\$ 54.359.334,54
--------------------	--------------------------	--------------------------

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 TESOURO NACIONAL	RS 715.970.041,79	12,18%	10,00%	100,00%	art 7º, inciso I, "a"
TOTAL art. 7º, inciso I, "a"	RS 715.970.041,79				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	RS 7.067.965,92	35,61%	22,00%	100,00%	art 7º, inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	RS 494.418.840,53				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	RS 487.102.355,11				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	RS 53.387.750,60				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	RS 804.109.373,07				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	RS 109.973.091,36				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	RS 84.472.535,27				
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	RS 52.131.708,44				
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	RS 2.092.663.620,30				
BRABESCO MAXI PODER PÚBLICO	RS 27.951.859,75	10,67%	13,00%	40,00%	art 7º, inciso IV, "a"
BRABESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	RS 16.360.742,72				
BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	RS 58.460.093,83				
BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	RS 48.837.964,01				
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	RS 475.078.867,90				
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	RS 109.477,89				
TOTAL art. 7º, inciso IV, "a"	RS 626.799.006,10				
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	RS 30.494.112,85	0,52%	3,00%	5,00%	art 7º, inciso VII, "b"
TOTAL art 7º, inciso VII, "b"	RS 30.494.112,85				
TOTAL RENDA FIXA	RS 3.465.926.781,04	58,98%			

Quadro 38.

11.2 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Variável

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2021		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BRABESCO INST IBR X ALPHA	RS 34.915.242,75	0,59%	3,00%	30,00%	art 8º, inciso I, "a"
TOTAL art 8º, inciso I, "a"	RS 34.915.242,75				
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESA FIC FIA	RS 41.407.149,99	28,07%	30,00%	30,00%	art 8º, inciso II, "a"
BRABESCO FIA MID SMALL CAPS	RS 186.079.016,74				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	RS 131.635.259,24				
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	RS 54.592.333,23				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	RS 187.382.224,65				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	RS 126.307.120,79				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	RS 134.523.460,80				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	RS 334.609.432,31				
SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	RS 15.269,75				
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	RS 91.722.177,49				
OCCAM FIC FIA	RS 134.634.402,43				
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	RS 113.054.982,71				
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	RS 34.350.025,33				
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	RS 60.007.834,84				
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	RS 9.697.343,66				
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	RS 9.735.635,99				
TOTAL art. 8º, inciso II, "a"	RS 1.649.753.669,95				
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	RS 37.450.008,77	2,31%	3,00%	3,00%	art 8º, inciso III
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	RS 98.560.440,40				
TOTAL art. 8º, inciso III	RS 136.010.449,17				
BTG ECONOMIA REAL FIP	RS 8.700.271,36	0,15%	2,00%	5,00%	art 8º, inciso IV, "a"
TOTAL art. 8º, inciso IV, "a"	RS 8.700.271,36				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	RS 1.829.379.633,23	31,13%			

Quadro 39.

Relatório de Investimentos – Julho/2021

11.3 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Investimentos no Exterior

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 51.276.223,24	4,98%	5,00%	10,00%	art 9º-A, inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXTERIOR	R\$ 140.903.141,13				
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 29.165.061,22				
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 35.983.949,74				
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 35.232.831,22				
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 292.561.206,55				
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	R\$ 143.917.898,04	4,91%	5,00%		art 9º-A, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NÍVEL I	R\$ 144.600.632,86				
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 288.518.530,90				
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 581.079.737,45	9,89%			
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 5.876.386.151,72	100%			

Quadro 40.

ALOCAÇÃO TOTAL DA CARTEIRA

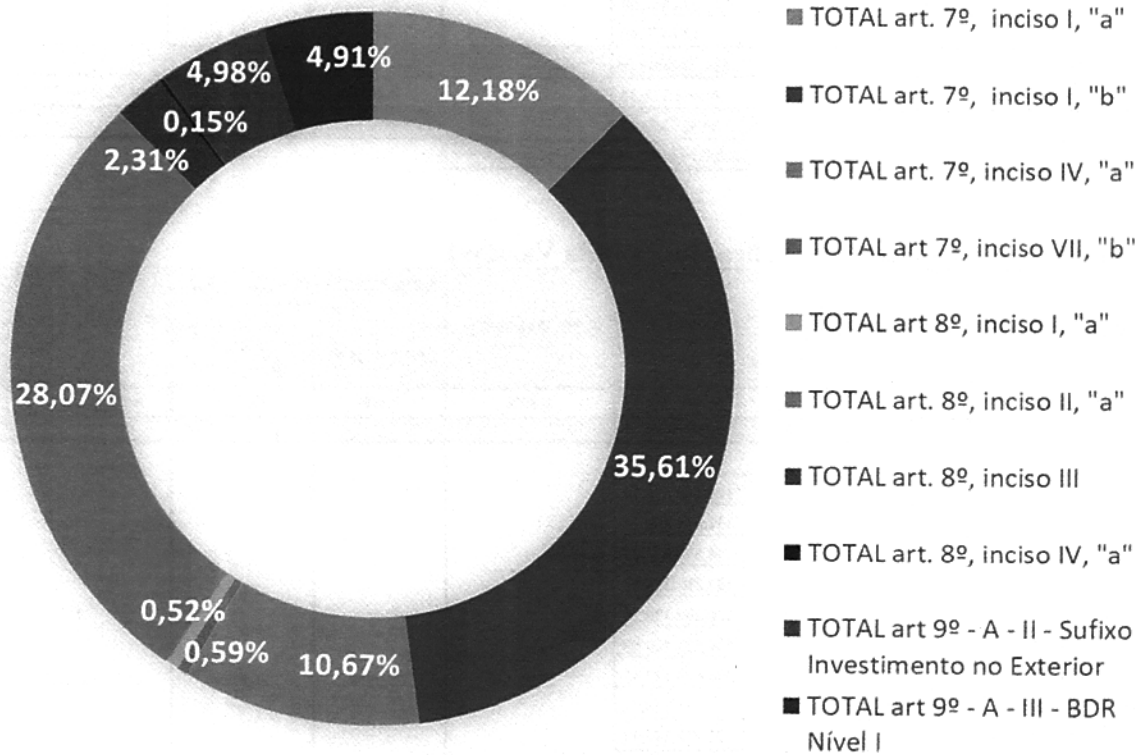


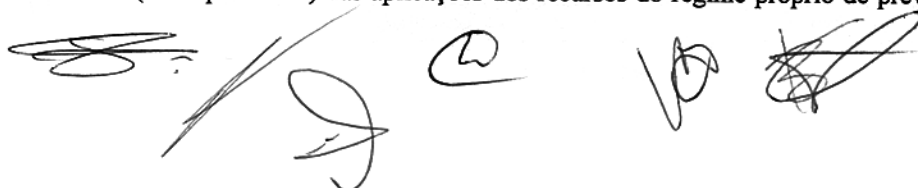
Gráfico 8.

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% CARTEIRA	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 7.067.965,92	0,12%	20%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 494.418.840,53	8,28%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 475.078.867,90	7,95%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 131.635.259,24	2,20%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 143.917.898,04	2,41%	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 51.276.223,24	0,86%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 487.102.355,11	8,15%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 53.387.750,60	0,89%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 27.951.859,75	0,47%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 16.360.742,72	0,27%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.460.093,83	0,98%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 48.837.964,01	0,82%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 34.915.242,75	0,58%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 186.079.016,74	3,11%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 109.477,89	0,00%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 804.109.373,07	13,46%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 41.407.149,99	0,69%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 187.382.224,65	3,14%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 126.307.120,79	2,11%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 54.592.333,23	0,91%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 134.523.460,80	2,25%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 30.494.112,85	0,51%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 109.973.091,36	1,84%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 84.472.535,27	1,41%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 334.609.432,31	5,60%	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 8.700.271,36	0,15%	
SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 15.269,75	0,00%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 140.903.141,13	2,36%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ -	0,00%	
VINCI MOSAICO INSTUCIONAL FIA	R\$ 113.054.982,71	1,89%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 37.450.008,77	0,63%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 52.131.708,44	0,87%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 144.600.632,86	2,42%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 91.722.177,49	1,54%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 134.634.402,43	2,25%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 34.350.025,33	0,58%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 9.697.343,66	0,16%	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 35.983.949,74	0,60%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 35.232.831,22	0,59%	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 60.007.834,84	1,00%	
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 98.560.440,40	1,65%	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 9.735.635,99	0,16%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 29.165.061,22	0,49%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO	R\$ 5.160.416.109,93		

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 – Julho/2021

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

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL DO FUNDO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	R\$ 7.067.965,92	R\$ 246.212.950,73	2,87%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 494.418.840,53	R\$ 10.405.647.705,91	4,75%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 475.078.867,90	R\$ 8.970.903.955,41	5,30%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 131.635.259,24	R\$ 1.187.017.261,48	11,09%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 143.917.898,04	R\$ 1.612.274.177,80	8,93%	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 51.276.223,24	R\$ 2.178.601.891,59	2,35%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 27.951.859,75	R\$ 662.997.429,20	4,22%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 16.360.742,72	R\$ 3.447.645.804,86	0,47%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.460.093,83	R\$ 1.155.055.229,01	5,06%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 48.837.964,01	R\$ 1.505.438.532,85	3,24%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 34.915.242,75	R\$ 624.428.790,29	5,59%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 186.079.016,74	R\$ 2.255.908.284,71	8,25%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 487.102.355,11	R\$ 14.363.834.668,17	3,39%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 53.387.750,60	R\$ 217.874.364,11	24,50%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 804.109.373,07	R\$ 15.935.689.880,45	5,05%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 54.592.333,23	R\$ 479.065.948,78	11,40%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 109.477,89	R\$ 3.344.605.737,75	0,00%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 41.407.149,99	R\$ 1.020.968.906,75	4,06%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 187.382.224,65	R\$ 3.453.398.725,17	5,43%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 126.307.120,79	R\$ 1.274.521.038,88	9,91%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 15.269,75	R\$ 358.457.220,33	0,00%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 140.903.141,13	R\$ 2.038.058.820,37	6,91%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 134.523.460,80	R\$ 1.169.640.883,53	11,50%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 109.973.091,36	R\$ 1.129.215.914,10	9,74%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 84.472.535,27	R\$ 925.417.916,06	9,13%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 52.131.708,44	R\$ 1.465.272.949,94	3,56%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 334.609.432,31	R\$ 2.947.905.302,72	11,35%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 144.600.632,86	R\$ 3.297.922.642,72	4,38%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 91.722.177,49	R\$ 2.317.656.614,41	3,96%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 134.634.402,43	R\$ 1.227.059.317,62	10,97%	
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 113.054.982,71	R\$ 1.640.952.244,33	6,89%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 34.350.025,33	R\$ 733.421.370,02	4,68%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ -	R\$ 605.400.421,31	0,00%	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 35.983.949,74	R\$ 116.913.857.462,76	0,03%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 35.232.831,22	R\$ 37.995.566.069,76	0,09%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 9.697.343,66	R\$ 105.536.731,70	9,19%	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 9.735.635,99	R\$ 305.220.195,92	3,19%	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 60.007.834,84	R\$ 701.005.859,10	8,56%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 29.165.061,22	R\$ 13.323.296.578,33	0,22%	
TOTAL	R\$ 4.985.211.276,55			

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14, § 1º	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Resolução CMN nº 3.922/2010
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 37.450.008,77	R\$ 1.584.576.000,04	2,36%	5%
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 98.560.440,40	R\$ 2.325.607.807,10	4,24%	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 8.700.271,36	R\$ 499.992.378,41	1,74%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 30.494.112,85	R\$ 1.002.360.153,68	3,04%	
TOTAL	R\$ 175.204.833,38			

TOTAL	R\$ 5.160.416.109,93
--------------	-----------------------------

Quadro 42.

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

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

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

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

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA JUNHO/2021) EM R\$ MI	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (JULHO/2021)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
CAIXA	R\$ 421.714,53	R\$ 1.399.191.812,01	0,3318%	5%
BB DTVM S.A	R\$ 1.283.840,15	R\$ 1.303.395.054,87	0,1015%	
BRADESCO	R\$ 541.767,99	R\$ 372.604.919,80	0,0688%	
ICATÚ VANGUARDA DTVM S/A	R\$ 33.996,22	R\$ 359.463.200,28	1,0574%	
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 779.289,57	R\$ 453.766.413,72	0,0582%	
BANCO BTG	R\$ 210.354,24	R\$ 353.007.047,33	0,1678%	
BANCO SAFRA	R\$ 107.084,07	R\$ 234.182.350,07	0,2187%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	R\$ 297.288,09	R\$ 140.918.410,88	0,0474%	
OCCAM BRASIL GESTÃO	R\$ 16.522,91	R\$ 134.634.402,43	0,8148%	
AZ QUEST INVESTIMENTOS	R\$ 15.697,14	R\$ 91.722.177,49	0,5843%	
PLURAL INVEST GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 32.990,52	R\$ 71.216.780,96	0,2159%	
SULAMERICA INVESTIMENTOS	R\$ 27.262,55	R\$ 34.350.025,33	0,1260%	
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL LTDA	R\$ 28.236,94	R\$ 29.165.061,22	0,1033%	
VINCI PARTNERS	R\$ 41.809,63	R\$ 113.054.982,71	0,2704%	
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	R\$ 57.750,75	R\$ 9.735.635,99	0,0169%	
BRASIL CAPITAL	R\$ 9.427,68	R\$ 60.007.834,84	0,6365%	

Quadro 43.

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

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

DISTRIBUIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR GESTOR DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS

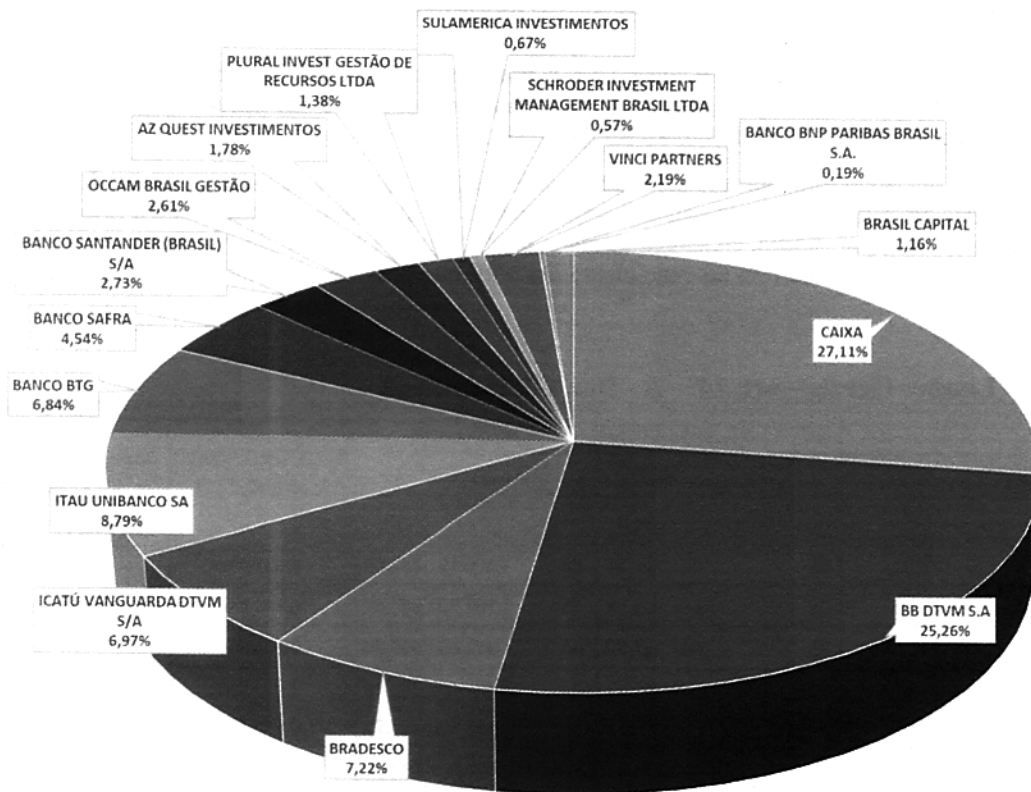


Gráfico 9.

(Handwritten signatures and scribbles)

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 5.160.416.109,93
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 715.970.041,79
TÍTULOS - CVS	R\$ 9.433.202,56
IMÓVEIS	R\$ 61.835.325,18
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 26.124.060,96
TOTAL	R\$ 5.973.778.740,42

Quadro 44.

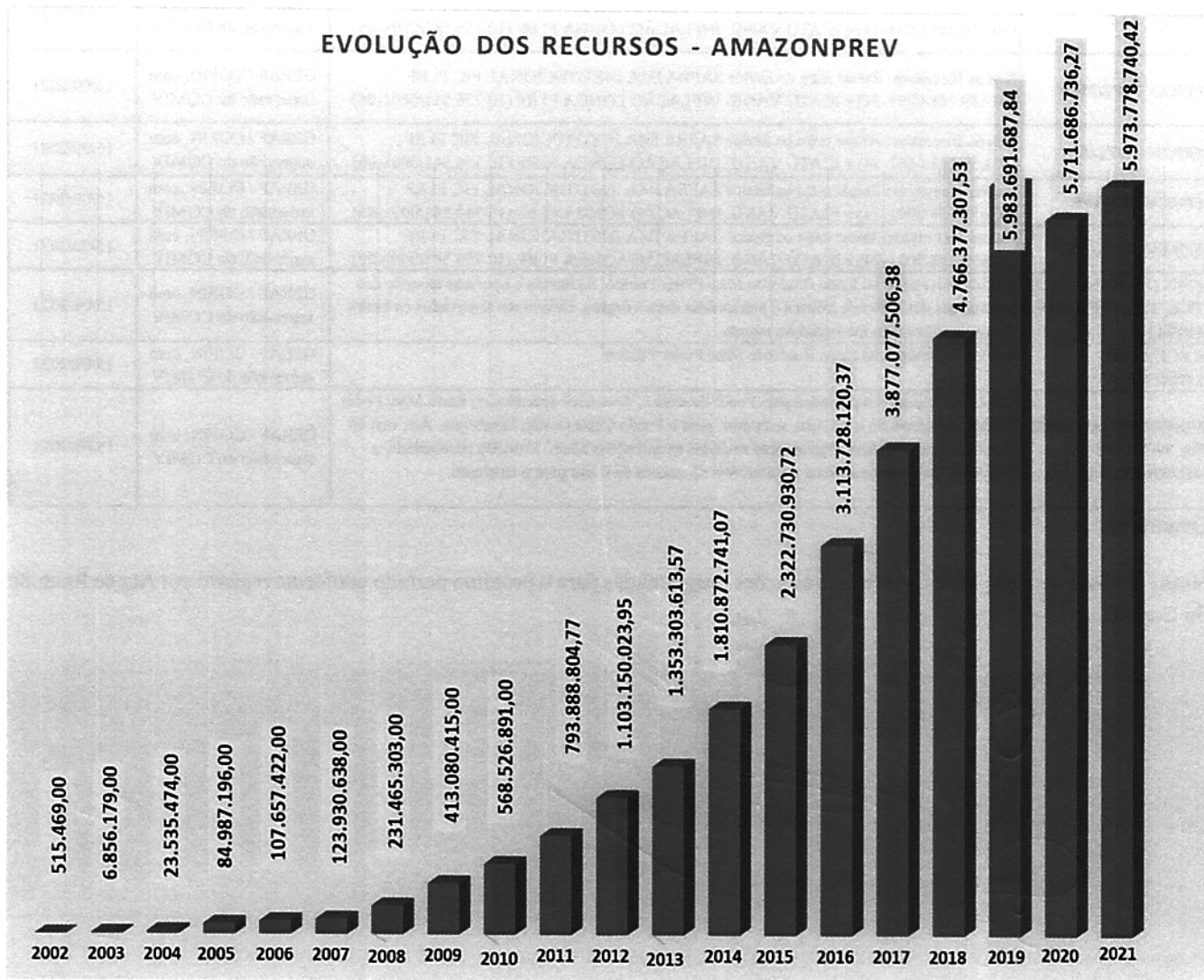


Gráfico 10.

[Handwritten signatures and initials]

Relatório de Investimentos – Julho/2021

13. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV EXECUTIVO:	a) Novos Recursos: Ratear entre os fundos SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF (30.659.168/0001-74) e ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF (10.756.541/0001-06)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/09/2021
	b) Recursos Atuais:		
	b1. Resgatar R\$ 153 milhões do fundo Caixa Gestão Estratégica, direcionando: R\$ 18 milhões no fundo MONGERAL AEGON CP FI RF LP (19.488.768/0001-84); no fundo R\$ 90 milhões SANTANDER RF CP CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP (17.138.474/0001-05); R\$ 45 milhões no fundo ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC FI (09.093.883/0001-04)		
	b2. Resgatar R\$ 100 milhões do fundo BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC FIA (11.977.794/0001-64) direcionando: R\$ 50 milhões para o fundo GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA (38.280.883/0001-03); R\$ 50 milhões para o fundo R\$ 50 milhões para o fundo BRADESCO FIA MID SMALL CAPS (06.988.623/0001-09)		
FPREV ALE:	Novos Recursos: Ratear entre os fundos SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF (30.659.168/0001-74) e ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF (10.756.541/0001-06)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/09/2021
FPREV MPE/PGJ:	Novos Recursos: Ratear entre os fundos SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF (30.659.168/0001-74) e ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF (10.756.541/0001-06)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/09/2021
FPREV - DPE/AM	Novos Recursos: Ratear entre os fundos SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF (30.659.168/0001-74) e ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF (10.756.541/0001-06)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/09/2021
FPREV - TJ/AM	Novos Recursos: Ratear entre os fundos SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF (30.659.168/0001-74) e ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF (10.756.541/0001-06)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/09/2021
FPREV - TCE/AM	Novos Recursos: Ratear entre os fundos SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF (30.659.168/0001-74) e ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF (10.756.541/0001-06)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/09/2021
FFIN (Executivo, ALE, TCE, TJA, MPE, DPE, EPPM)	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	15/09/2021
RECURSOS COMPREV	Aplicar os recursos no fundo Bradesco Maxi Poder Público.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/09/2021
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	15/09/2021

Quadro 45.

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

 GOVERNO DO ESTADO DO AMAZONAS

AMAZONPREV
Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



RELATÓRIOS - 2021

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

Relatório de Investimentos – Julho/2021

TOTAL RENDA FIXA	R\$	3.376.422.694,32
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$	1.829.379.633,23
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$	581.079.737,45
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$	5.786.882.065,00

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso I, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	jul/21	2021
						RETORNO	RETORNO	RETORNO
TÍTULOS DO TN	R\$ 705.368.209,63	R\$ 715.970.041,79						
TOTAL - art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 705.368.209,63	R\$ 715.970.041,79						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso I, "b"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	jul/21	2021
						RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Prev RF Tit Publ VII FI	R\$ 7.021.922,22	R\$ 7.067.965,92	1,68%	0,17%	-0,71	6,53%	0,66%	2,86%
Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	R\$ 53.486.644,54	R\$ 53.387.750,60	4,94%	0,51%	-4,08	-1,90%	-0,18%	-2,45%
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	R\$ 487.037.431,15	R\$ 487.102.355,11	2,56%	0,26%	-1,22	4,77%	0,01%	1,17%
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	R\$ 760.968.333,78	R\$ 755.066.105,64	2,48%	0,26%	-1,49	0,90%	-0,78%	-0,06%
Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	R\$ 110.017.589,71	R\$ 109.973.091,36	2,62%	0,27%	-1,23	4,49%	-0,04%	1,04%
Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	R\$ 71.694.943,01	R\$ 84.472.535,27	8,63%	0,89%	-7,51	-0,01%	-0,81%	-3,50%
Safrira Ima Institucional Fc FI RF	R\$ 38.960.470,37	R\$ 52.131.708,44	6,70%	0,69%	-5,22	0,52%	-0,58%	-2,58%
BB Prev RF Idka 2 FI	R\$ 494.006.544,54	R\$ 494.418.840,53	2,34%	0,24%	-1,10	5,61%	0,08%	1,50%
TOTAL - art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 2.023.193.879,32	R\$ 2.043.620.352,87						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso IV, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	jul/21	2021
						RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Prev RF Alocacao Ativa Fcfi	R\$ 478.327.234,13	R\$ 475.078.867,90	2,92%	0,30%	-2,14	0,55%	-0,25%	-0,93%
Bradesco Fc FI RF Alocacao Dinamica	R\$ 48.959.686,21	R\$ 48.837.964,01	3,11%	0,32%	-2,49	0,10%	-0,20%	-1,00%
Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	R\$ 58.850.835,88	R\$ 58.460.093,83	2,73%	0,28%	-1,52	4,15%	-0,02%	0,66%
Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	R\$ 3.839.020,80	R\$ 3.851.783,18	0,32%	0,03%	-0,55	1,92%	0,37%	1,54%
Itau Instit Alocacao Dinamica RF FICFI	R\$ 109.307,50	R\$ 109.477,89	0,50%	0,05%	-0,57	1,19%	0,16%	1,16%
TOTAL - art. 7º, inciso IV, "a"	R\$ 590.086.084,52	R\$ 586.338.186,81						

Relatório de Investimentos – Julho/2021

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso II, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	jul/21	2021
						RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Ações Valor FICFIA	R\$ 134.759.990,05	R\$ 131.635.259,24	20,45%	2,11%	-15,12	24,15%	-2,32%	2,10%
Bradesco FIA Mid Small Caps	R\$ 192.669.862,29	R\$ 186.079.016,74	19,79%	2,04%	-10,66	17,74%	-3,42%	9,66%
BTG Pactual Absolute Inst FIC FIA	R\$ 350.645.138,37	R\$ 334.609.432,31	20,43%	2,11%	-9,04	8,25%	-4,57%	-0,31%
Caixa FIA Consumo	R\$ 57.660.335,15	R\$ 54.592.333,23	21,61%	2,23%	-10,57	1,49%	-5,32%	-2,77%
Icatu Vanguardia Dividendos FIA	R\$ 141.475.860,39	R\$ 134.523.460,80	18,39%	1,90%	-12,49	6,58%	-4,91%	-1,81%
Itau Acoes Dunamis Fc	R\$ 193.329.777,63	R\$ 187.382.224,65	18,65%	1,92%	-8,11	23,74%	-3,08%	8,77%
Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	R\$ 43.379.484,68	R\$ 41.407.149,99	19,46%	2,01%	-10,50	14,33%	-4,55%	1,24%
Itau Institucional Acoes Phoenix Fc	R\$ -	R\$ -	21,94%	2,26%	-15,49	13,76%	-0,66%	9,23%
Itau Small Cap Master FIA	R\$ 132.579.095,03	R\$ 126.307.120,79	20,60%	2,13%	-9,56	28,01%	-4,40%	10,55%
Sant Selecao Cresc Senior Acoes Fc FI	R\$ 15.929,19	R\$ 15.269,75	20,30%	2,09%	-12,22	9,91%	-4,14%	-1,64%
Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes	R\$ -	R\$ -	20,46%	2,11%	-11,97	12,35%	-3,98%	0,92%
Sant Selecao Crescimento Acoes Fc FI	R\$ 50.118.024,34	R\$ -	20,30%	2,09%	-12,23	9,95%	-4,14%	-1,60%
Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	R\$ 95.977.480,58	R\$ 91.722.177,49	20,21%	2,08%	-11,36	15,38%	-4,43%	8,27%
Occam Fc de FIA	R\$ 140.414.242,48	R\$ 134.634.402,43	20,77%	2,14%	-12,30	13,55%	-4,12%	0,31%
Sul America Equities FIA	R\$ 35.530.813,06	R\$ 34.350.025,33	19,57%	2,02%	-13,52	7,93%	-3,32%	2,06%
BTG Pactual Dividendos FIC FIA	R\$ 10.095.244,17	R\$ 9.697.343,66	19,38%	2,00%	-11,72	5,10%	-3,94%	-1,12%
Vinci Mosaico Institucional FIA	R\$ 93.450.092,45	R\$ 113.054.982,71	19,17%	1,98%	-10,27	13,09%	-4,11%	0,91%
Vinci Selection Equities FIA	R\$ 10.805.858,17	R\$ -	17,74%	1,83%	-10,60	12,91%	-3,77%	2,58%
Brasil Capital Master 30 II FIA	R\$ 37.382.920,59	R\$ 60.007.834,84	19,94%	2,06%	-10,06	16,76%	-2,40%	2,54%
BNP Paribas Master Acoes FI	R\$ 10.213.459,72	R\$ 9.735.635,99						
TOTAL - art. 8º, inciso II, "a"	R\$ 1.730.503.608,34	R\$ 1.649.753.669,95						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso III	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	jul/21	2021
						RETORNO	RETORNO	RETORNO
Safra S P Reais Pb FI Mut	R\$ 25.083.798,67	R\$ 37.425.481,51	14,73%	1,52%	-9,70	34,57%	2,58%	18,78%
Itau Private Mut S&P500 Brl Fc	R\$ 96.084.448,40	R\$ 98.584.967,66	14,88%	1,54%	-9,74	35,33%	2,58%	19,12%
TOTAL - art. 8º, inciso III	R\$ 121.168.247,07	R\$ 136.010.449,17						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso IV, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	jul/21	2021
						RETORNO	RETORNO	RETORNO
BTG Pactual Economia Real FIP	R\$ 6.673.983,04	R\$ 8.700.271,36						
TOTAL - art. 8º, inciso IV, "a"	R\$ 6.673.983,04	R\$ 8.700.271,36						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	jul/21	2021
						RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Mut Global Select Equity Ie FI	R\$ 48.033.137,01	R\$ 51.276.223,24	20,75%	2,15%	-8,48	38,64%	6,75%	16,53%
Santander Global Equities Dólar Master Mult Ie FI	R\$ 133.940.637,57	R\$ 140.903.141,13	18,50%	1,91%	-8,91	32,38%	5,20%	12,97%
Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	R\$ 27.425.874,78	R\$ 29.165.061,22	21,11%	2,18%	-8,49		6,34%	16,25%
Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	R\$ 34.609.268,58	R\$ 35.232.831,22			-10,83		1,80%	7,78%
Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	R\$ 33.716.359,34	R\$ 35.983.949,74			-8,60		6,73%	7,14%
TOTAL - art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 277.725.277,28	R\$ 292.561.206,55						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	jul/21	2021
						RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Acoes Esg FIA - Bdr Nível I	R\$ 136.629.325,85	R\$ 143.917.898,04	21,00%	2,17%	-12,65	29,48%	5,33%	14,30%
Safra Consumo Americano FIA Bdr Nível I	R\$ 136.140.219,07	R\$ 144.600.632,86	20,74%	2,14%	-11,99	34,47%	6,21%	17,37%
TOTAL - TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 272.769.544,92	R\$ 288.518.530,90						

Quadro 1.

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

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

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

Nota 3: DRAWDOWN: Auxilia a determinar o risco de um investimento ao medir seu declínio desde o valor máximo alcançado pelo ativo, até o valor mínimo atingido em determinado período de tempo. Para determinar o percentual de queda,

[Handwritten signatures and initials]

Relatório de Investimentos – Julho/2021

o Draw-Down é medido desde que a desvalorização começa até se atingir um novo ponto de máximo, garantindo, dessa forma, que a mínima da série representa a maior queda ocorrida no período. Quanto mais negativo o número, maior a perda ocorrida e, conseqüentemente, maior o risco do ativo. Já um Draw-Down igual a zero, indica que não houve desvalorização do ativo ao longo do período avaliado.

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

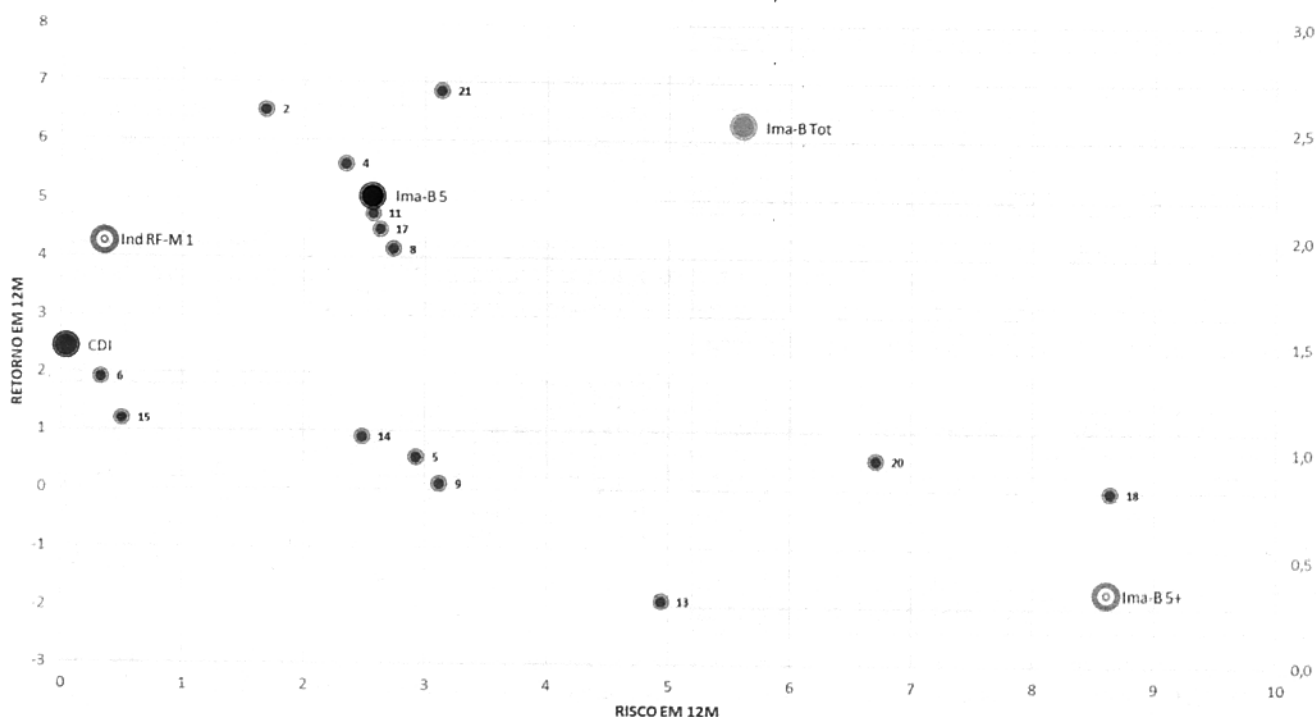


Gráfico 1: Art. 7º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Código	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
2	art. 7º, inciso I, "b"	BB Prev RF Tit Publ VII FI	390739<BraNa>	6,53	1,68	D+000	D+000
4	art. 7º, inciso I, "b"	BB Prev RF Idka 2 FI	272612<BraNa>	5,61	2,34	D+001	D+001
5	art. 7º, inciso IV, "a"	BB Prev RF Alocacao Ativa Fcfl	423041<BraNa>	0,55	2,92	D+003	D+003
6	art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	179991<BraNa>	1,92	0,32	D+000	D+000
8	art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	374131<BraNa>	4,15	2,73	D+001	D+001
9	art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco Fc FI RF Alocacao Dinamica	456306<BraNa>	0,10	3,11	D+003	D+004
11	art. 7º, inciso I, "b"	FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	251496<BraNa>	4,77	2,56	D+000	D+000
13	art. 7º, inciso I, "b"	Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	401862<BraNa>	-1,90	4,94	D+000	D+000
14	art. 7º, inciso I, "b"	Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	427683<BraNa>	0,90	2,48	D+000	D+000
15	art. 7º, inciso IV, "a"	Itau Instt Alocacao Dinamica RF FICFI	399892<BraNa>	1,19	0,50	D+000	D+001
17	art. 7º, inciso I, "b"	Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	231932<BraNa>	4,49	2,62	D+000	D+001
18	art. 7º, inciso I, "b"	Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	244953<BraNa>	-0,01	8,63	D+000	D+001
20	art. 7º, inciso I, "b"	Safra Ima Institucional Fc FI RF	478180<BraNa>	0,52	6,70	D+003	D+004
21	art. 7º, inciso VII, "b"	Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	367354<BraNa>	6,85	3,13	D+005	D+006

Quadro 2. Legenda Gráfico 1.

(Handwritten signatures and initials)

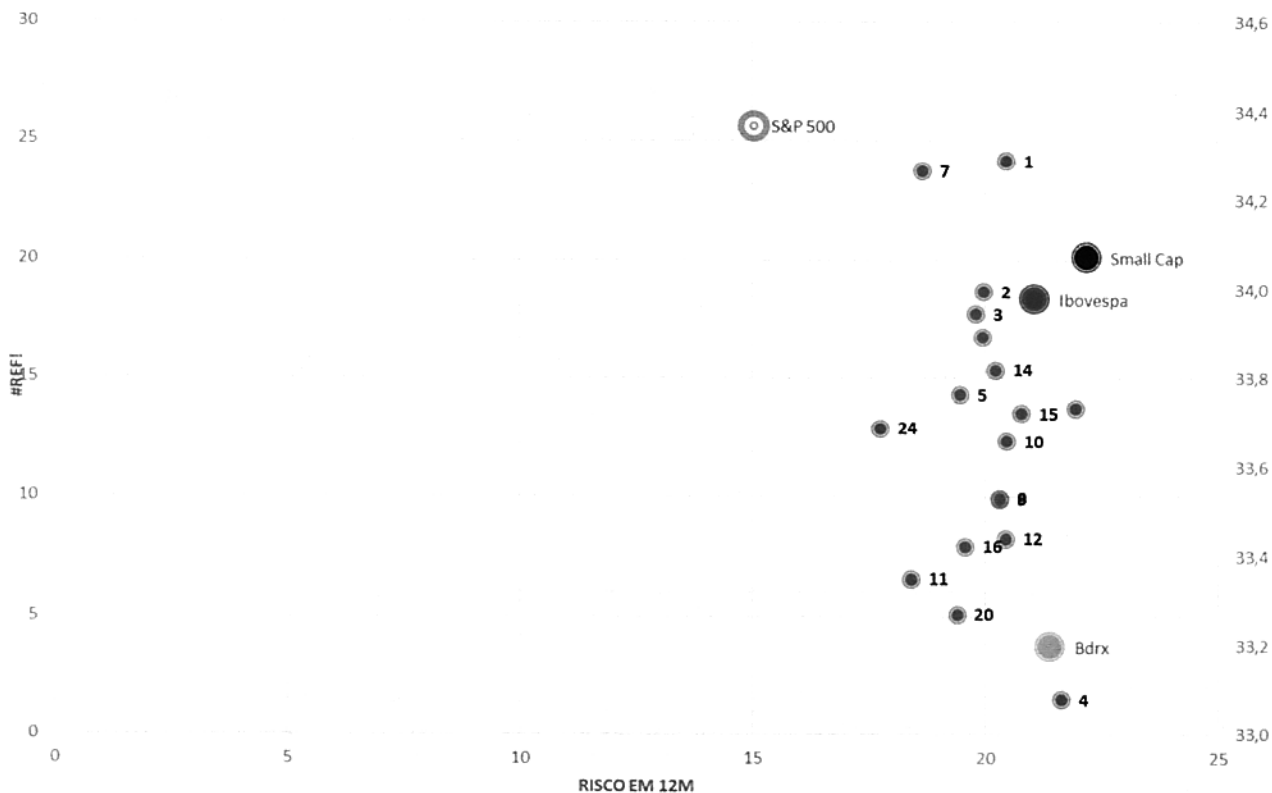


Gráfico 2: Art. 8º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Código	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art. 8º, inciso II, "a"	BB Ações Valor FICFIA	458236<BraNa>	24,15	20,45	D+030	D+032
2	art. 8º, inciso I, "a"	Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	326712<BraNa>	18,69	19,97	D+000	D+002
3	art. 8º, inciso II, "a"	Bradesco FIA Mid Small Caps	131679<BraNa>	17,74	19,79	D+001	D+003
4	art. 8º, inciso II, "a"	Caixa FIA Consumo	302198<BraNa>	1,49	21,61	D+001	D+003
5	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	208507<BraNa>	14,33	19,46	D+002	D+002
6	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Institucional Acoes Phoenix Fc	424838<BraNa>	13,76	21,94	D+021	D+023
7	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Acoes Dunamis Fc	423701<BraNa>	23,74	18,65	D+021	D+023
8	art. 8º, inciso II, "a"	Sant Selecao Crescimento Acoes Fc FI	464066<BraNa>	9,95	20,30	D+027	D+029
9	art. 8º, inciso II, "a"	Sant Selecao Cresc Senior Acoes Fc FI	053872<BraNa>	9,91	20,30	D+001	D+003
10	art. 8º, inciso II, "a"	Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes	055840<BraNa>	12,35	20,46	D+001	D+003
11	art. 8º, inciso II, "a"	Icatu Vanguarda Dividendos FIA	173126<BraNa>	6,58	18,39	D+001	D+003
12	art. 8º, inciso II, "a"	BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	252311<BraNa>	8,25	20,43	D+001	D+032
14	art. 8º, inciso II, "a"	Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	520772<BraNa>	15,38	20,21	D+027	D+029
15	art. 8º, inciso II, "a"	Occam Fc de FIA	378100<BraNa>	13,55	20,77	D+001	D+003
16	art. 8º, inciso II, "a"	Sul America Equities FIA	255173<BraNa>	7,93	19,57	D+001	D+003
20	art. 8º, inciso II, "a"	BTG Pactual Dividendos FIC FIA	206032<BraNa>	5,10	19,38	D+001	D+003
24	art. 8º, inciso II, "a"	Vinci Selection Equities FIA	320196<BraNa>	12,91	17,74	D+060	D+062
25	art. 8º, inciso II, "a"	Brasil Capital Master 30 II FIA	564680<BraNa>	16,76	19,94	D+000	D+002
26	art. 8º, inciso II, "a"	BNP Paribas Master Acoes FI	318256<BraNa>			D+000	D+003

Quadro 3. Legenda Gráfico 2.

Handwritten signatures and initials in black ink, including a large signature and several smaller initials.

Relatório de Investimentos – Julho/2021

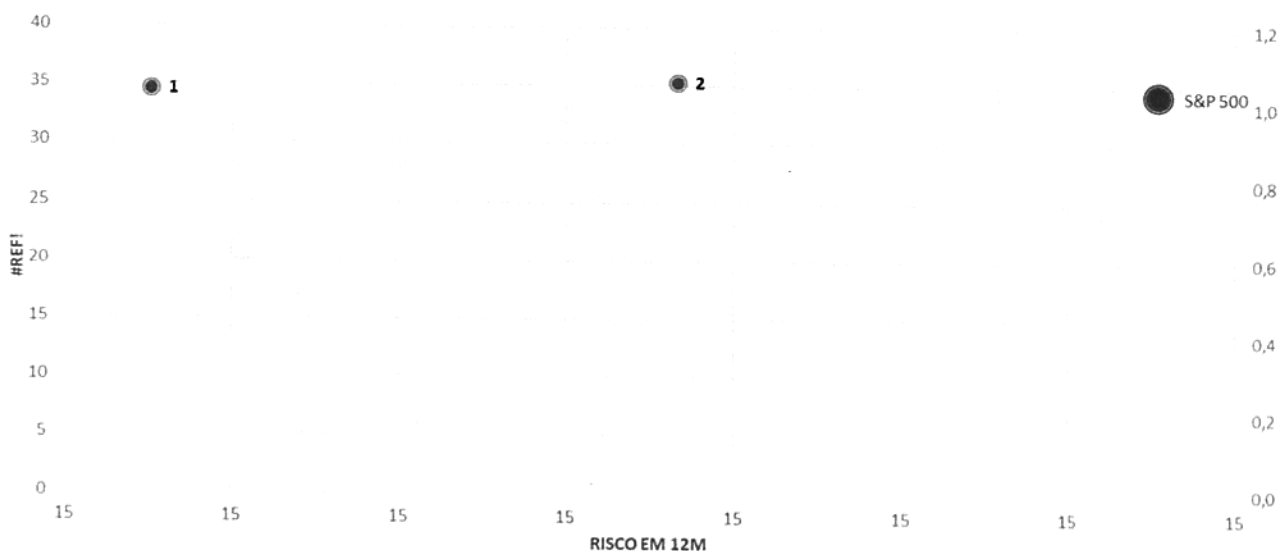


Gráfico 3: Art. 8-III,º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Código	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art.8º, inciso III	Safra S P Reais Pb FI Mult	401447<BraNa>	34,57	14,73	D+001	D+002
2	art.8º, inciso III	Itau Private Mult S&P500 Bri Fc	433756<BraNa>	35,33	14,88	D+000	D+001

Quadro 4. Legenda Gráfico 3.

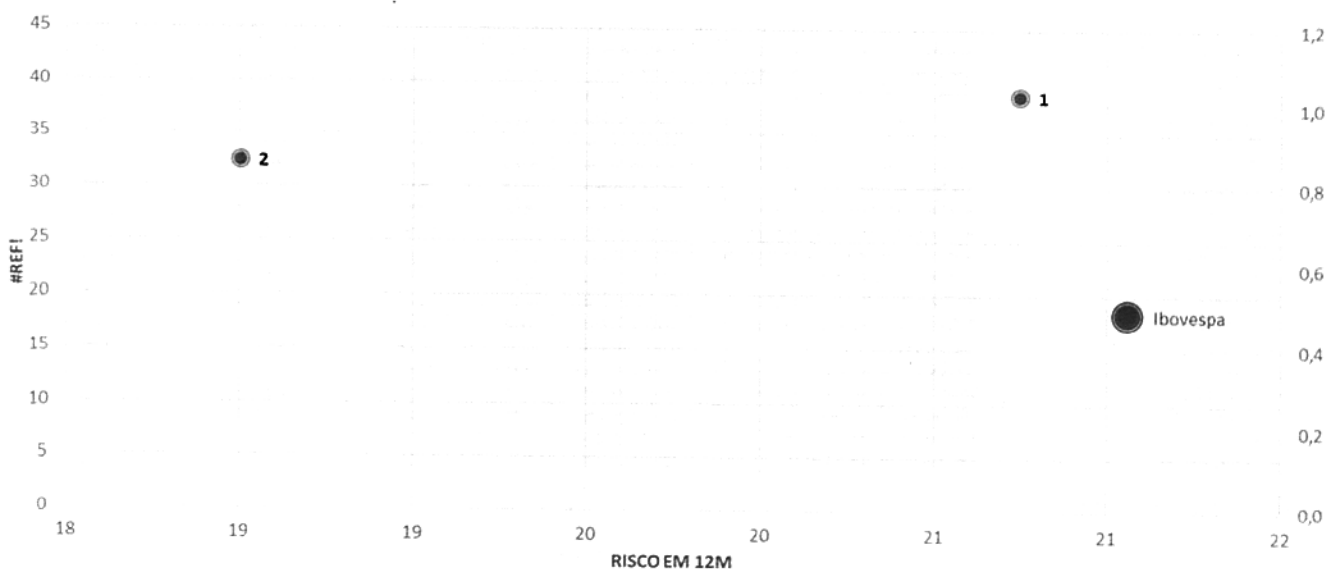


Gráfico 4: Art. 9º-A-II Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Código	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	BB Mult Global Select Equity Ie FI	349208<BraNa>	38,64	20,75	D+001	D+005
2	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Santander Global Equities Dólar Master Mult	346063<BraNa>	32,38	18,50	D+001	D+008
3	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	548049<BraNa>		21,11	D+001	D+004
4	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	559024<BraNa>			D+001	D+006
5	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	557862<BraNa>			D+001	D+006

Quadro 5. Legenda Gráfico 4.

Handwritten signatures and initials, including a large stylized 'S' and several scribbles.

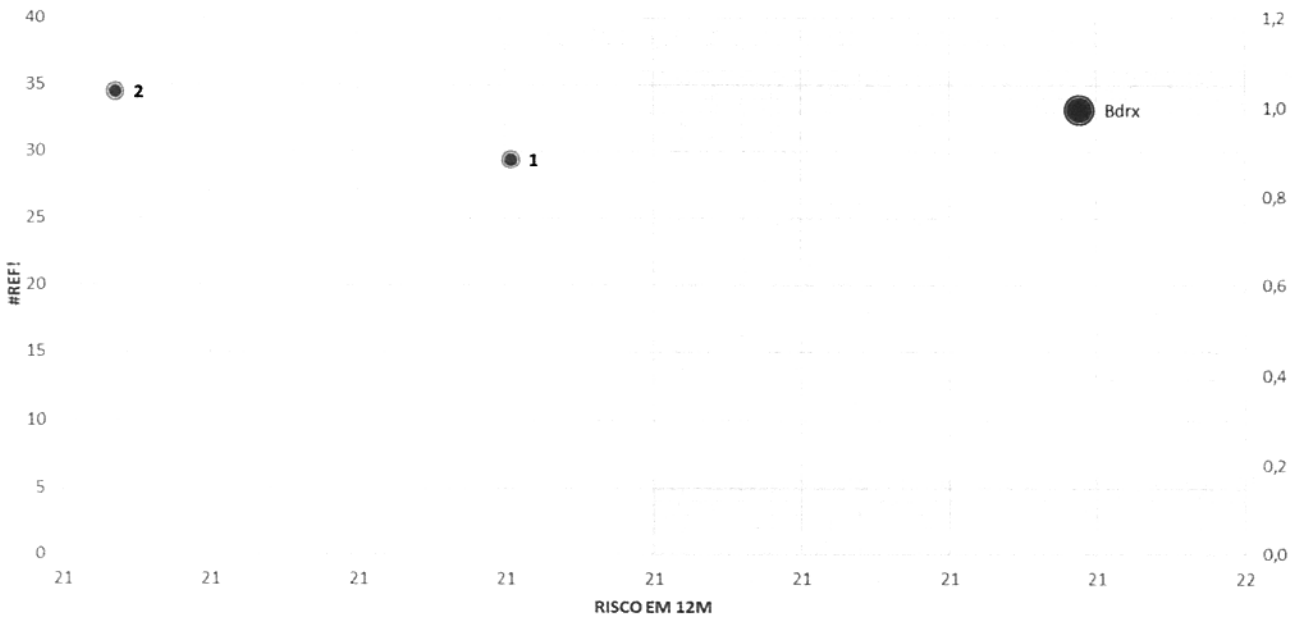


Gráfico 5: Art. 9-A-IIIº Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Código	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art 9º - A - III - BDR Nível I	BB Acoes Esg FIA - Bdr Nível I	387061<BraNa>	29,48	21,00	D+001	D+004
2	art 9º - A - III - BDR Nível I	Safra Consumo Americano FIA Bdr Nível I	359130<BraNa>	34,47	20,74	D+001	D+004

Quadro 6. Legenda Gráfico 5.

Relatório de Investimentos – Julho/2021

2. VERIFICAÇÃO DE LASTRO DOS FUNDOS DE RISCO DE CRÉDITO

DATA BASE EM 30.07.21

TABELA - DURATION & YIELD POR CLASSE			
Ativo	Duration	Spread	% PL
DEB	3,53	1,70%	63,7%
CRI	0,00	0,00%	0,0%
LF	2,91	1,72%	14,8%
CDB	1,25	0,70%	0,0%
DPGE	0,00	0,00%	0,0%
NP	0,91	2,12%	1,0%
BOND	0,00	0,00%	0,0%
FIDC	0,00	0,00%	0,0%
NTN-B	3,96	-	13,1%
Over	0,00	-	7,4%
Carteira Crédito	3,38	1,71%	79,6%
Crédito - Contribuição Fundo	1,38	1,36%	79,6%
Fundo (Inclui DAP e NTN-B)	3,09	1,36%	100,0%

Quadro 03

TABELA - RATING EXTERNO*		
Rating	Financeiro	% PL
AAA	213.084.648	21,3%
AA+	150.611.963	15,0%
AA	146.165.061	14,6%
AA-	127.166.925	12,7%
A+	66.490.203	6,6%
DPGE	0	0,0%
A	3.082.279	0,3%
A-	20.287.046	2,0%
BBB+	0	0,0%
BBB	0	0,0%
BBB-	0	0,0%
BB+	10.219.623	1,0%
BB	0	0,0%
BB-	0	0,0%
B+	0	0,0%
B	0	0,0%
B-	0	0,0%
CCC	0	0,0%
CC	0	0,0%
C	0	0,0%
Sem Rating	60.374.096	6,0%
Tesouro / Over	204.892.190	20,4%
Total	1.002.374.034	100,0%

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

Quadro 04.

TABELA - SETOR		
Setor	Financeiro	% PL
Elétrico	197.198.537	19,7%
Bancos	148.839.389	14,8%
Serviço	98.628.463	9,8%
Conc. Rodoviárias	97.890.368	9,8%
Saneamento	87.366.642	8,7%
Varejo	54.193.384	5,4%
Shopping Center	32.836.050	3,3%
Logística	22.759.139	2,3%
Infraestrutura	17.873.836	1,8%
Holding	9.905.048	1,0%
Indústria e Comércio	9.861.714	1,0%
Mineração e Siderurgia	9.105.581	0,9%
Óleo e Gás	8.706.150	0,9%
Papel e Celulose	2.317.543	0,2%
Tesouro / Over	204.892.190	20,4%
Total	1.002.374.034	100,0%

Quadro 05.

Nota: Dados referentes ao fundo ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CREDITO PRIVADO LP. (base: 30/07/2021)

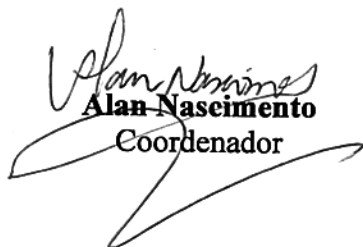
PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 16 de agosto de 2021, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de julho/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.

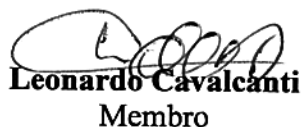
Todas as operações efetuadas, são acompanhadas pelo Controles Internos, e aprovadas pela Diretoria, com base nas Atas de Reunião do Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev.

Manaus – AM, 16 de agosto de 2021.

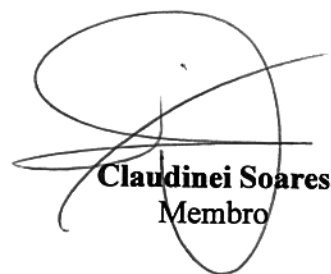

Alan Nascimento
Coordenador


Bruno Costa Novo
Secretário

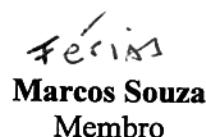

Bruno Barroso
Membro


Leonardo Cavalcanti
Membro


Andreza de Souza Silva
Membro


Claudinei Soares
Membro


André Luiz Bentes
Membro


Marcos Souza
Membro

