

Destino: DIRAF / PRESI

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

Data: 13/09/2021

## RELATÓRIO Nº. 015 / 2021 – COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **Agosto/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).

Handwritten signatures and initials at the bottom right of the page, including a large signature and the number 2.

### 1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

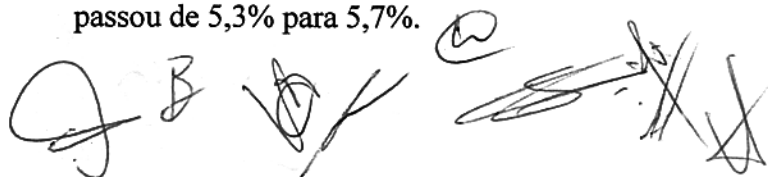
O Banco Central elevou a taxa básica de juros em 100 pb. Em decisão unânime, a autoridade monetária elevou a taxa Selic de 4,25% para 5,25%, confirmando as expectativas do mercado. O movimento marca a continuidade do processo de ajuste da taxa de juros e sancionou o cenário deixado em aberto na última reunião do Copom, segundo o qual uma deterioração das expectativas de inflação exigiria redução mais tempestiva dos estímulos monetários.

No comunicado, o Copom indicou ser apropriado elevar a taxa de juros para patamar acima do considerado neutro para garantir a ancoragem das expectativas de inflação. Na avaliação sobre o cenário, o comitê continua antevendo recuperação robusta da atividade econômica no segundo semestre e um ambiente global favorável para as economias emergentes. A pressão inflacionária, por sua vez, tem se revelado mais persistente do que o esperado e com composição mais desfavorável, destacando-se a elevação de núcleos gerada tanto por uma maior inflação subjacente de serviços como pela continuada pressão de bens industriais. Além disso, condições climáticas adversas incidentes sobre preços de alimentos e energia têm gerado revisões nas projeções de curto prazo.

Para a próxima reunião, o Banco Central indicou um aperto monetário de mesma magnitude. O ajuste reflete a percepção do Copom de que a piora recente em componentes inerciais dos índices de preços, em momento de reabertura do setor de serviços, poderia provocar deterioração adicional das expectativas, de forma que é necessário ser mais tempestivo no ajuste da política monetária. Espera-se que o Banco Central eleve a taxa de juros para 8% ao final do atual ciclo de política monetária. Em termos de atividade, o Índice do Banco Central de atividade (IBC-Br) avançou 1,1% na margem em junho. O indicador prévio do PIB registrou resultado abaixo da expectativa (1,3%), mas acima da expectativa do mercado (0,6%). O indicador repercutiu o crescimento no volume de serviços (1,7%), estabilidade na indústria e recuo de 2,3% das vendas no varejo. Com o resultado, a média do índice no 2º trimestre representa alta de 0,1% em relação à média do 1º trimestre. Na comparação interanual, o índice teve alta de 9,1%. O IBC-Br passou a se situar 1,3% acima do patamar pré-pandemia (média de janeiro e fevereiro de 2020).

Em julho, os dados de atividade devem ser novamente beneficiados pelo aumento da mobilidade.

A prévia da inflação ao consumidor (IPCA-15) variou 0,89% em agosto. O resultado veio acima da projeção da BRAM e da mediana do mercado, ambas em 0,83%. A inflação acumulada em 12 meses apresentou nova aceleração, de 8,9% em julho para 9,3% em agosto. Com relação aos núcleos, que são métricas que excluem ou suavizam itens com inflação volátil, a leitura de agosto revelou uma nova piora do quadro inflacionário. A média dos núcleos teve variação de 0,57% e, no acumulado em doze meses, passou de 5,3% para 5,7%.

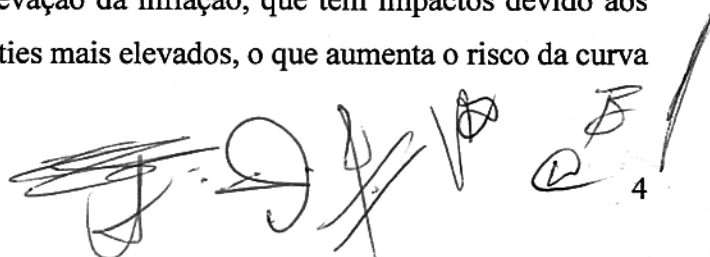


De modo geral, as leituras mais recentes de inflação confirmam aceleração de preços de serviços com a reabertura da economia. A inflação de bens, no entanto, não mostra tendência clara de desaceleração, como seria esperado nesse quadro. O cenário inflacionário para os próximos meses, portanto, segue pressionado. Os riscos de alta advêm tanto dos preços de alimentos, com problemas de oferta de produtos in natura e proteínas, como de bens, com os baixos estoques e escassez de insumos ainda afetando os preços. Ademais, o risco advindo da crise hídrica não pode ser minimizado. Para o final deste ano a BRAM registra projeção de IPCA é de 7,6%.

Nos EUA, o Fed divulgou a ata da reunião de julho, na qual os membros mostraram a maior necessidade de debates sobre a redução no grau de estímulo monetário. Em linhas gerais, a maioria dos membros defendeu que, diante da evolução da economia, o início da redução da compra de ativos no mercado americano poderá ter início ao final deste ano. No entanto, foi enfatizado que essa redução não possui ligação com um possível aumento da taxa de juros básica. Sobre o cenário econômico, a ata revela que o comitê apresenta visão favorável para a atividade econômica, mas que existem riscos no curto prazo. As autoridades julgam que a incerteza da nova variante Delta da Covid-19 pode ser um desafio para o mercado de trabalho, podendo atrasar a reabertura total da economia. Os membros seguem com a avaliação que a aceleração recente da inflação reflete um movimento temporário. Avalia-se que o Fed deverá adotar uma estratégia de redução gradual da compra de ativos ao final desse ano.

As prévias dos índices de confiança (PMI) de agosto vieram ligeiramente abaixo do esperado, mas ainda corroboram o cenário de crescimento robusto. O PMI Composto prévio da Zona do Euro, que incorpora as expectativas da indústria e dos serviços atingiu 59,5 pontos em agosto ante 60,2 em julho, sinalizando a continuidade da expansão da economia (nível acima de 50 pontos indica expansão). Nos EUA, o PMI Composto pelo segundo mês consecutivo apresentou queda, com um recuo de 59,9 pontos para 55,4 pontos entre julho e agosto. Os números revelam ainda um efeito positivo sobre a demanda de consumo e investimento diante do aumento da mobilidade, mas ressaltam o problema do aumento de custos. O aumento de casos da COVID-19 causados pela nova variante Delta é um risco iminente para o avanço nos próximos meses na oferta de produtos e nas expectativas futuras dos índices de confiança do mercado. Acredita-se que esse risco materializará de modo a produzir uma queda significativa da atividade global.

**Perspectivas Renda Fixa** – A recuperação econômica global passa por um momento de estabilização, que é saudável dada a intensidade que vista até então. A redução das barreiras sanitárias e o avanço da variante Delta têm elevado o número de novos casos de COVID-19 pelo mundo, tendo como destaque Reino Unido e EUA. Dito isso, os efeitos dessa nova onda de contaminação têm trazido incerteza e feito com que os investidores busquem aplicações de menor risco, a exemplo dos títulos da dívida americana. Outro ponto que tem aumentando a incerteza é a elevação da inflação, que tem impactos devido aos gargalos no setor produtivo e os preços das commodities mais elevados, o que aumenta o risco da curva



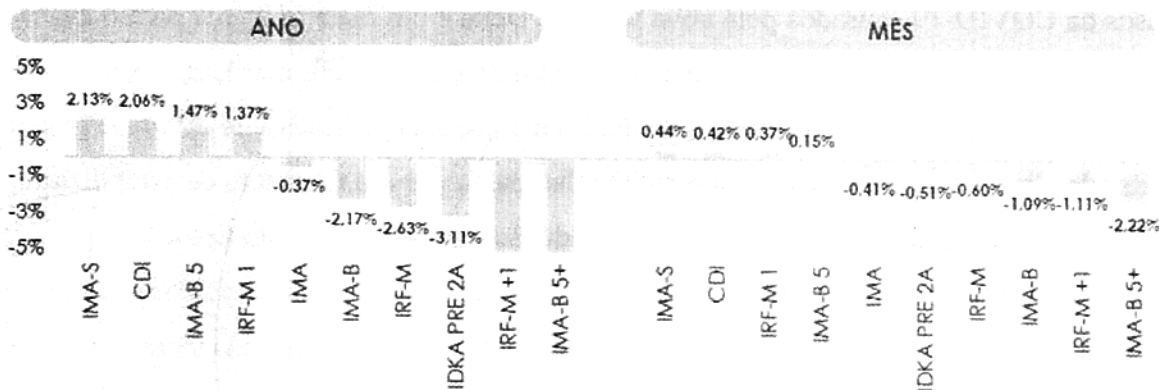
4

## Relatório de Investimentos – Agosto/2021

de juros, elevando as taxas pelo mundo, principalmente, nos vencimentos de 2, 5 e 10 anos. As commodities começaram a desacelerar, mantendo-se em patamar ainda elevado, destaque para a intensidade da queda dos preços das commodities metálicas. Por fim, o banco central americano se mostrou paciente com relação à pressão inflacionária atual e não deve antecipar a redução da compra de títulos ou aumento de juros.

Aqui no Brasil, o ambiente é de riscos fiscais crescentes, mesmo tendo mais espaço no teto de gastos devido a correção pela inflação e a queda da relação de dívida PIB. O governo segue com uma retórica expansionista que piora as perspectivas do endividamento e, conseqüentemente, piora a precificação dos ativos de risco por aqui. Adicionalmente, as preocupações com o cenário inflacionário seguem em alta, principalmente quando se considera que o pior momento da crise hídrica ainda não foi atingido, por isso o governo está aumentando os valores da bandeira tarifária vermelha, além do incremento ao risco de um possível racionamento de energia. Por fim, a vacinação contra COVID-19 na população segue avançando, o que tem permitido uma retomada mais clara das atividades. Os números de contágio e mortes estão em queda, e todos seguem atentos aos impactos da variante Delta, que pode chegar ao Brasil nos próximos meses. Por fim, 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 é de uma Selic por volta de 8% no final de 2021. O mercado viu uma abertura na curva de juros em todos os vencimentos, tanto na curva prefixada quanto na atrelada à inflação. O Real segue como uma moeda atrativa quando ponderado o risco pela taxa de juros do Brasil, entretanto o cenário local tem dificultado a entrada de investidores e, quando comparado a uma cesta de moedas emergentes, o real sofreu um impacto pequeno. O Dólar fechou o mês a 5,14, com uma alta de 0,42% e no ano ainda segue com uma queda de 1,03%. Fonte: Carta do Gestor emitido pela BRAM Asset Management.

### RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA FIXA



Fonte: Carta ao Gestor\_BRAM - Setembro/2021

*[Handwritten signatures and initials]*

**Perspectivas Renda Variável** – No mês de agosto, as bolsas dos EUA foram mais uma vez o grande destaque mundial, refletindo o otimismo com a economia americana e taxas de juros futuros mais comportadas. Por outro lado, as bolsas dos países europeus e da América Latina continuam com pior performance devido às preocupações com a variante delta da COVID- 19, 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 +2,90% e o MSCI Emerging Markets 2,42%. Estes índices acumulam retorno no ano de +20,41% e +1,35%, 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. O risco hídrico e a inflação complementam as preocupações de curto prazo. As pequenas e médias empresas tiveram mais um mês de performance negativa e abaixo do Ibovespa, que teve retorno de -2,48%, acumulando retorno quase nulo no ano de -0,20%.

O fluxo do investidor estrangeiro voltou a ficar positivo em agosto e continua bastante positivo no ano. 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, risco fiscal e risco hídrico permanecem como pontos de atenção. Além disso, o balanço de forças entre a expectativa de novos pacotes de estímulo fiscal nos EUA e o ambiente local são elementos que, para a gestão, 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 pela frente. Sobre a performance setorial, o mês foi bem positivo para os setores mais defensivos e/ou com exposição cambial em suas receitas como Papel & Celulose, Bens de Capital, Petróleo e Serviços Públicos. Do lado negativo, setores impactados com alta de juros e queda dos preços do minério de ferro ajudam a explicar a performance de Mineração e Siderurgia, Shoppings & Properties e Serviços Financeiros.

**RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA VARIÁVEL**

	AGOSTO	2021	12 MESES	24 MESES	36 MESES
S&P 500 USD	2,90%	20,41%	29,21%	54,54%	55,87%
MSCI WORLD USD	2,35%	16,78%	27,93%	46,89%	44,40%
SMLL CAPS	-3,82%	0,95%	16,98%	24,03%	87,36%
IBRX100	-3,25%	1,07%	20,88%	19,52%	61,19%
IDIV	-0,50%	-0,20%	19,40%	15,05%	72,87%
IBOVESPA	-2,48%	-0,20%	19,54%	17,45%	54,91%

Fonte: Carta ao Gestor\_BRAM - Setembro/2021

## Relatório de Investimentos – Agosto/2021

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

#### 2.1 SALDOS E PERFORMANCE RENDA FIXA

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/07/2021	31/08/2021	jun/21	jul/21	ago/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 324.169.581,13	R\$ 319.383.413,83	0,1114	(0,2496)	(0,4488)	-0,5867%	-1,3737%	0,9914%	
BB PREVID TP VII	R\$ 7.067.965,92	R\$ 6.903.508,85	0,3499	0,6557	0,4531	1,4656%	3,3221%	6,5148%	
BB PREVID IDKA 2	R\$ 291.605.886,89	R\$ 292.126.309,27	(0,0935)	0,0834	0,1784	0,1682%	1,6836%	NC	
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 3.851.783,18	R\$ 2.283.391,61	0,3000	0,3700	0,4174	1,0914%	1,9636%	2,1981%	
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 53.387.750,60	R\$ 51.974.456,22	(0,3300)	(0,1800)	(0,0400)	-0,5492%	-0,0800%	0,5578%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 487.102.355,11	R\$ 478.165.994,06	(0,1400)	0,0139	0,1338	0,0075%	1,3039%	4,4984%	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 528.291.268,67	R\$ 520.633.244,45	(0,0030)	(0,7756)	(1,4496)	-2,2169%	-1,5125%	-0,0077%	
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 28.503.585,37	R\$ 28.456.070,19	0,2200	0,0600	(0,1700)	0,1097%	2,3300%	6,0900%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 109.973.091,36	R\$ 101.598.955,76	(0,1500)	(0,0400)	0,0900	-0,1001%	1,1300%	4,2300%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 84.472.535,27	R\$ 113.883.345,17	0,8200	(0,8100)	(2,3100)	-2,3067%	-5,7200%	1,4000%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 21.320,58	R\$ 21.385,93	0,2900	0,1600	0,3100	0,7619%	1,4700%	1,6300%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 52.131.708,44	R\$ 82.580.457,04	0,4400	(0,5800)	(1,5600)	-1,7003%	-4,1000%	1,0000%	
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>R\$ 1.981.315.916,97</b>	<b>R\$ 1.998.010.532,38</b>							

Quadro 1.

#### 2.2 SALDOS E PERFORMANCE RENDA VARIÁVEL

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/07/2021	31/08/2021	jun/21	jul/21	ago/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 109.119.630,83	R\$ 107.144.334,56	(0,7741)	(2,3187)	(1,8102)	-4,8294%	0,2519%	26,3960%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 186.079.016,74	R\$ 180.950.260,02	0,8900	(3,4200)	(2,7600)	-5,2498%	6,6300%	16,3300%	
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 333.005.194,79	R\$ 310.289.217,29	1,2878	(4,5700)	(6,8215)	-9,9347%	-7,1011%	-0,8600%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FI AÇÕES	R\$ 9.697.343,66	R\$ 9.367.603,53	(0,0382)	(3,9400)	(3,4003)	-7,2418%	-4,4891%	NC	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 8.700.271,36	R\$ 13.593.912,65	(0,5260)	(4,4200)	14,2457	8,6216%	30,8641%	NC	
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 33.781.065,63	R\$ 4.335.803,18	0,5100	(5,3208)	(4,0389)	-8,6814%	-6,6929%	-1,0371%	
ICATU VANGUARDIA DIVIDENDOS FIA	R\$ 133.992.708,69	R\$ 130.040.318,19	(0,6300)	(4,9100)	(2,9500)	-8,2965%	-4,7000%	8,3000%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 187.382.224,65	R\$ 183.250.047,82	(0,2100)	(3,0800)	(2,2100)	-5,4210%	6,3700%	21,2500%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 41.407.149,99	R\$ 40.109.943,84	0,5800	(4,5500)	(3,1300)	-7,0013%	-1,9300%	14,1900%	
ITAU SMALL CAPS VALUATION	R\$ 126.307.120,79	R\$ 121.331.358,38	1,1900	(4,7300)	(3,9400)	-7,3946%	4,7400%	21,4000%	
ITAÚ MM SP500 BRL FIC	R\$ 98.407.409,24	R\$ 101.710.930,00	2,6800	2,5800	3,3600	8,8682%	9,2928%	NC	
SANTANDER CRESC SENIOR (TOP AÇÕES)	R\$ 15.269,75	R\$ 14.949,19	1,0303	(4,1373)	(2,0993)	-5,1828%	-3,7007%	9,5589%	
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 25.731.786,58	R\$ 26.587.067,66	2,6900	2,5800	3,3200	8,8367%	22,7300%	30,1200%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 91.722.177,49	R\$ 87.074.310,93	1,6200	(4,4300)	(5,0700)	-7,8057%	2,7900%	13,0800%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 132.484.654,00	R\$ 129.251.558,11	(0,4800)	(4,1200)	(2,4400)	-6,9085%	-2,1400%	13,3200%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 34.350.025,33	R\$ 33.037.251,68	1,3964	(3,3233)	(3,8217)	-5,7196%	-1,8446%	5,9566%	
BRASIL CAPITAL RP INSTIT FIC AÇÕES	R\$ 52.509.665,05	R\$ 51.420.807,48	2,3200	(2,6600)	(2,0700)	-2,4634%	-3,0700%	NC	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 9.735.635,99	R\$ 9.353.806,68	1,0300	(4,6784)	(3,9220)	-7,4736%	-7,0481%	NC	
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ -	R\$ 9.489.877,60	-	-	(0,2726)	-0,2726%	-0,2726%	NC	
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ -	R\$ 20.625.459,21	-	-	(3,9729)	-3,9729%	-3,9729%	NC	
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 113.054.982,71	R\$ 110.567.540,40	(0,4300)	(4,1100)	(2,2000)	-6,6228%	-6,6228%	NC	
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$ 1.727.483.333,27</b>	<b>R\$ 1.679.546.358,40</b>							

Quadro 2.

**2.3 SALDOS E PERFORMANCE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR**

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)					
	30/07/2021	31/08/2021		jun/21	jul/21	ago/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 22.874.479,24	R\$ 23.082.616,81		(4,6145)	6,7517	0,9099	2,7522%	17,5861%	NC
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 140.903.141,13	R\$ 142.748.664,51		(2,8238)	5,1982	1,3098	3,5666%	14,4400%	21,2000%
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 29.165.061,22	R\$ 29.753.755,74		(3,7200)	6,3400	2,0200	4,4523%	18,5900%	NC
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 143.917.898,04	R\$ 148.366.133,69		(2,2458)	5,3345	3,0908	6,1515%	17,8322%	16,2510%
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 143.111.291,79	R\$ 146.321.116,64		(0,2100)	6,2100	2,2400	8,3611%	20,0100%	18,5200%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 35.983.949,74	R\$ 36.163.559,47		(0,0009)	6,7255	0,4991	7,2572%	6,6249%	NC
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 35.232.831,22	R\$ 36.087.222,99		8,3783	1,8017	2,4250	13,0065%	4,2462%	NC
<b>TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>	<b>R\$ 551.188.652,38</b>	<b>R\$ 562.523.069,85</b>							
<b>TOTAL GERAL</b>	<b>R\$ 4.259.987.902,62</b>	<b>R\$ 4.240.079.960,63</b>							

Quadro 3.

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

**Nota 2:** As movimentações nesse mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. 177/21: 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 para aplicar recursos no fundo BTB Pactual Investimentos de Impacto FIP (referente a primeira chamada de capital) a partir dos recursos aplicados no fundo CAIXA IMA B5.

**Nota 4:** Foi realizada a aplicação no mês de agosto/2021, do valor de R\$ 21.000.000,00 (vinte e um milhões de reais) no fundo Daycoval Ibovespa Ativo FI Ações conforme determinado pela Diretoria através do Despacho DIRAF de 25/06/2021, tendo como origem recursos do fundo Caixa Consumo FI Ações.

**2.4 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**

INSTITUIÇÃO	jun/21	jul/21	ago/21
BRASESCO	R\$ 196.508.883,09	R\$ 200.667.884,37	R\$ 183.233.651,63
BANCO DO BRASIL	R\$ 895.191.835,46	R\$ 898.755.442,05	R\$ 897.006.317,01
CAIXA	R\$ 1.108.624.418,28	R\$ 1.102.562.440,01	R\$ 1.055.109.497,91
ITAÚ	R\$ 465.244.906,36	R\$ 453.525.225,25	R\$ 446.423.665,97
SANTANDER	R\$ 184.074.591,10	R\$ 140.918.410,88	R\$ 142.763.613,70
ICATU	R\$ 351.115.412,87	R\$ 356.941.920,69	R\$ 373.978.689,31
SAFRA	R\$ 198.782.286,65	R\$ 220.974.786,81	R\$ 255.488.641,34
BTG PACTUAL	R\$ 365.733.247,14	R\$ 351.402.809,81	R\$ 342.740.611,07
AZ QUEST	R\$ 95.977.480,58	R\$ 91.722.177,49	R\$ 87.074.310,93
OCCAM BRASIL	R\$ 138.172.205,58	R\$ 132.484.654,00	R\$ 129.251.558,11
SCHRODER	R\$ 27.425.874,78	R\$ 29.165.061,22	R\$ 29.753.755,74
SULAMÉRICA	R\$ 35.530.813,06	R\$ 34.350.025,33	R\$ 33.037.251,68
PLURAL INVEST	R\$ 68.325.627,92	R\$ 71.216.780,96	R\$ 72.250.782,46
BRASIL CAPITAL	R\$ 29.679.455,16	R\$ 52.509.665,05	R\$ 51.420.807,48
BNP PARIBAS	R\$ 10.213.459,72	R\$ 9.735.635,99	R\$ 9.353.806,68
DAYCOVAL	R\$ -	R\$ -	R\$ 20.625.459,21
VINCI PARTNERS	R\$ 104.255.950,62	R\$ 113.054.982,71	R\$ 110.567.540,40
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 4.274.856.448,37</b>	<b>R\$ 4.259.987.902,62</b>	<b>R\$ 4.240.079.960,63</b>

Quadro 4.

BVA  
S

# Relatório de Investimentos – Agosto/2021

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXEC AGOSTO/2021

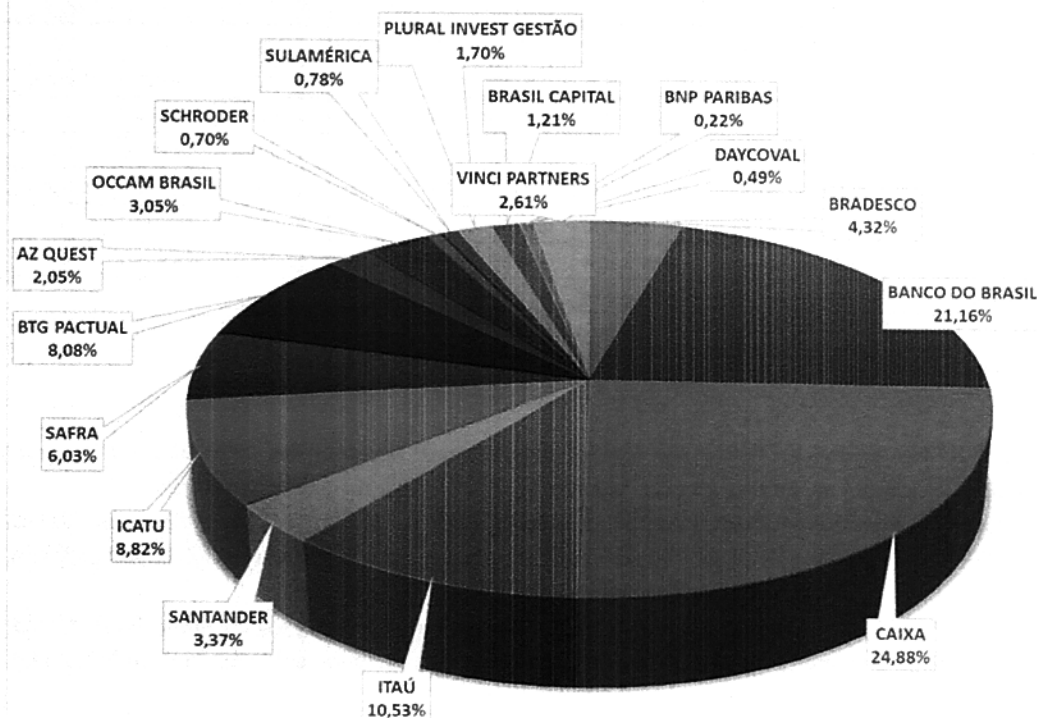


Gráfico 1.

## 2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/07/2021	31/08/2021	jun/21	jul/21	ago/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 169.998.036,04	R\$ 167.742.200,99	1,0574	1,4896	1,3992	3,998%	10,1903%	16,7869%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 177.342.747,23	R\$ 175.135.812,05	1,0668	1,4991	1,4087	4,027%	10,2729%	16,9183%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 182.180.452,43	R\$ 184.790.059,75	1,0905	1,5229	1,4324	4,100%	10,4799%	17,2475%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 184.022.582,29	R\$ 181.884.494,17	1,0669	1,4992	1,4087	4,027%	10,2731%	16,9185%
<b>TOTAL GERAL</b>	<b>R\$ 713.543.818,00</b>	<b>R\$ 709.552.566,96</b>						

Quadro 5.

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

**Nota 2:** Registrado o pagamento semestral de cupom de Títulos Públicos no valor total de R\$ 14.133.098,30, motivo da redução do valor total aplicado.

*[Handwritten signatures and initials]*



**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\$ 167.742.200,99	R\$ 175.135.812,05	R\$ 184.790.059,75	R\$ 181.884.494,17
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**

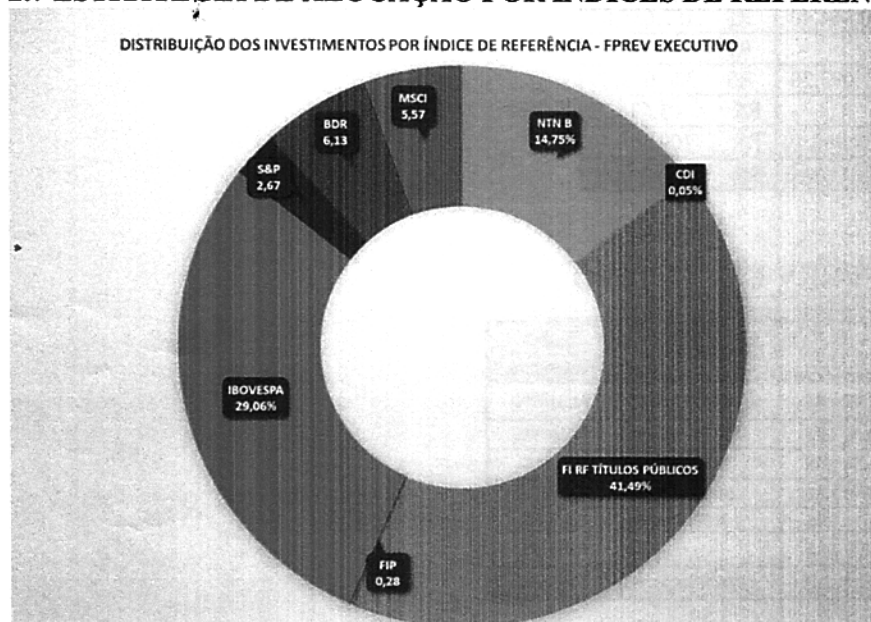


Gráfico 2.

**2.8 SALDOS CVS – FPREV**

DESCRIÇÃO	SALDO	
	30/07/2021	31/08/2021
CVS - A	R\$ 1.135.279,54	R\$ 1.117.826,22
CVS - B	R\$ 7.345.157,90	R\$ 7.232.180,10
CVS - C	R\$ 147.270,76	R\$ 145.006,68
CVS - D	R\$ 805.494,36	R\$ 793.104,84
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 9.433.202,56</b>	<b>R\$ 9.288.117,84</b>

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.

*(Handwritten signatures and initials)*

## Relatório de Investimentos – Agosto/2021

### 2.9 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/21	R\$ 30.247,09	R\$ 145.084,72	R\$ 175.331,81
fev/21	R\$ 29.827,12	R\$ 145.084,72	R\$ 174.911,84
mar/21	R\$ 29.407,16	R\$ 145.084,72	R\$ 174.491,88
abr/21	R\$ 28.978,18	R\$ 145.084,72	R\$ 174.062,90
mai/21	R\$ 28.567,21	R\$ 145.084,72	R\$ 173.651,93
jun/21	R\$ 28.147,25	R\$ 145.084,72	R\$ 173.231,97
jul/21	R\$ 27.727,27	R\$ 145.084,72	R\$ 172.811,99
ago/21	R\$ 27.307,30	R\$ 145.084,72	R\$ 172.392,02
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 230.208,58</b>	<b>R\$ 1.160.677,76</b>	<b>R\$ 1.390.886,34</b>

Quadro 8.

### 2.10 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2021 (Contrato Regular)			
MÊS	UEA	SEAS	TOTAL
jan/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -
fev/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -
mar/21	R\$ -	R\$ 100.364,40	R\$ 100.364,40
abr/21	R\$ 87.271,44	R\$ 100.364,40	R\$ 187.635,84
mai/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -
jun/21	R\$ -	R\$ 301.093,20	R\$ 301.093,20
jul/21	R\$ 43.635,72	R\$ -	R\$ 43.635,72
ago/21	R\$ -	R\$ 100.364,40	R\$ 100.364,40
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 130.907,16</b>	<b>R\$ 602.186,40</b>	<b>R\$ 733.093,56</b>

Quadro 9.

### 2.11 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	30/07/2021	31/08/2021	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.259.987.902,62	R\$ 4.240.079.960,63	84,3167%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 713.543.818,00	R\$ 709.552.566,96	14,1099%
TÍTULOS CVS	R\$ 9.433.202,56	R\$ 9.288.117,84	0,1847%
IMÓVEIS	R\$ 61.835.325,18	R\$ 61.835.325,18	1,2296%
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	R\$ 8.000.000,00	0,1591%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 10.466.516,40	R\$ 1,00	0,0000%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 5.055.266.764,76</b>	<b>R\$ 5.028.755.971,61</b>	<b>100,00%</b>

Quadro 10.

### 2.12 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Annual	12 Meses
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%
<b>ago/21</b>	<b>R\$ 5.028.755.971,61</b>	<b>-0,52%</b>	<b>4,59%</b>	<b>4,82%</b>

Quadro 11.

## 2.13 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

### 1. Investimentos - Executivo

<b>Saldo dos Investimentos em 08/2020</b>			R\$ 4.797.635.488,57
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
09/2020	R\$ 39.934.090,22	R\$ 109.739.936,23	R\$ -69.805.846,01
10/2020	R\$ 38.961.921,68	R\$ 112.188.198,10	R\$ -73.226.276,42
11/2020	R\$ 39.697.646,11	R\$ 116.368.518,74	R\$ -76.670.872,63
12/2020	R\$ 117.527.713,10	R\$ 175.934.562,52	R\$ -58.406.849,42
01/2021	R\$ 584.279,15	R\$ 82.104.432,44	R\$ -81.520.153,29
02/2021	R\$ 40.864.605,59	R\$ 44.974.382,51	R\$ -4.109.776,92
03/2021	R\$ 41.485.170,47	R\$ 10.665.619,53	R\$ 30.819.550,94
04/2021	R\$ 41.308.639,76	R\$ 10.074.221,86	R\$ 31.234.417,90
05/2021	R\$ 41.318.216,48	R\$ 14.353.928,89	R\$ 26.964.287,59
06/2021	R\$ 50.044.250,01	R\$ 10.611.950,64	R\$ 39.432.299,37
07/2021	R\$ 47.181.791,70	R\$ 9.896.860,10	R\$ 37.284.931,60
08/2021	R\$ 26.451.714,66	R\$ 11.394.062,81	R\$ 15.057.651,85
<b>Saldo dos Investimentos em 08/2021</b>			R\$ 5.028.755.971,61

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

<b>Taxa de Juros Anual</b>	5,4500 %	<b>Índice de Inflação</b>	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	9,6797 %	5,6732 %	0,8700 %
Juros	5,4500 %	3,6011 %	0,4432 %
Meta	15,6572 %	9,4786 %	1,3171 %
Rentabilidade em %	9,0649 %	2,6204 %	-0,8223 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 414.067.118,48	R\$ 125.592.753,46	R\$ -41.568.445,00
Resultado em %	-5,6999 %	-6,2643 %	-2,1115 %
Resultado em R\$	R\$ -301.299.080,31	R\$ -328.625.136,65	R\$ -108.149.229,15

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 – Agosto/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						
	30/07/2021	31/08/2021	jun/21	jul/21	ago/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 5.183.752,16	R\$ 5.108.609,32	(0,0030)	(0,7756)	(1,4496)	-2,2169%	-1,5125%	-0,0077%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 88.157,31	R\$ 88.427,53	0,2900	0,1600	0,3100	0,7619%	1,4700%	1,6300%	
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 1.990.527,48	R\$ 1.987.209,29	0,2200	0,0600	(0,1700)	0,1097%	0,0600%	2,3300%	
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 353.777,44	R\$ 354.408,82	(0,0935)	0,0800	0,1784	0,1648%	1,6836%	5,0819%	
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>R\$ 7.616.214,39</b>	<b>R\$ 7.538.654,96</b>							
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO						
	30/07/2021	31/08/2021	jun/21	jul/21	ago/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 530.752,11	R\$ 515.096,48	(0,6300)	(4,9100)	(2,9500)	-8,2965%	-4,7000%	8,3000%	
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 1.604.237,52	R\$ 1.494.804,33	1,2878	(4,5700)	(6,8215)	-9,9347%	-7,1010%	-0,8600%	
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 500.047,79	R\$ 479.851,60	0,5186	(5,3208)	(4,0389)	-8,6736%	-6,6929%	-1,0371%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 2.149.748,43	R\$ 2.097.286,94	(0,4800)	(4,1200)	(2,4400)	-6,9085%	-2,1400%	13,3200%	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 140.283,77	R\$ 137.374,80	2,3200	(2,6600)	(2,0700)	-2,4634%	-3,0700%	-3,0700%	
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 177.558,42	R\$ 403.216,25	-	2,5800	3,3200	5,9857%	22,7300%	30,1200%	
ITAÚ MM SP500 BRL FIC	R\$ 153.031,16	R\$ 158.168,39	2,6800	2,5800	3,3600	8,8682%	23,1200%	30,7700%	
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$ 5.255.659,20</b>	<b>R\$ 5.285.798,79</b>							
FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO						
	30/07/2021	31/08/2021	jun/21	jul/21	ago/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 1.489.341,07	R\$ 1.522.745,31	(0,2100)	6,2100	2,2400	8,3611%	20,0100%	18,5200%	
<b>TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>	<b>R\$ 1.489.341,07</b>	<b>R\$ 1.522.745,31</b>							
<b>TOTAL GERAL</b>	<b>R\$ 14.361.214,66</b>	<b>R\$ 14.347.199,06</b>							

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 (%)						
	30/07/2021	31/08/2021	jun/21	jul/21	ago/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.426.223,79	R\$ 2.397.728,33	1,0905	1,5229	1,4324	4,1001%	10,4798%	17,2474%	
<b>TOTAL GERAL</b>	<b>R\$ 2.426.223,79</b>	<b>R\$ 2.397.728,33</b>							

Quadro 14.

### 3.3 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	30/07/2021	31/08/2021
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 7.616.214,39	R\$ 7.538.654,96
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 5.255.659,20	R\$ 5.285.798,79
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.489.341,07	R\$ 1.522.745,31
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.426.223,79	R\$ 2.397.728,33
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 16.787.438,45</b>	<b>R\$ 16.744.927,39</b>

Quadro 15.

3.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

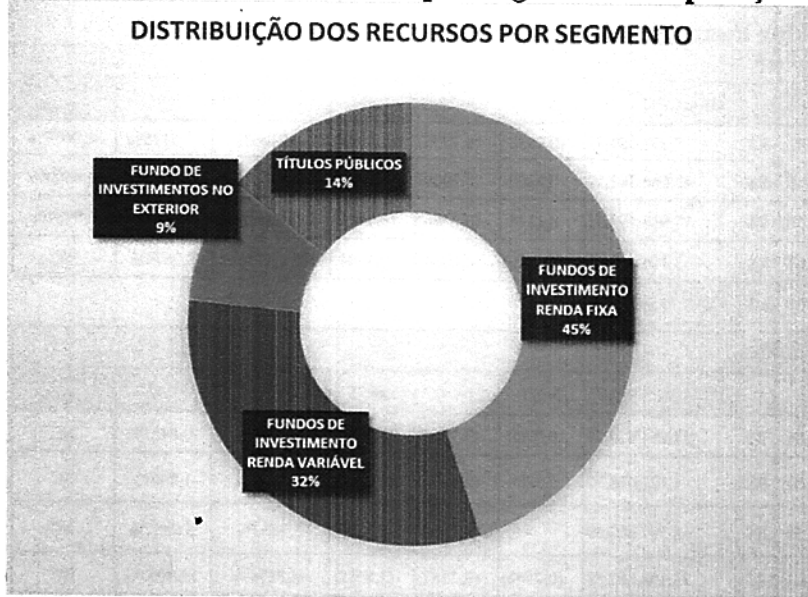


Gráfico 3.

3.5 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

1. Investimentos - Assembléia

Saldo dos Investimentos em 08/2020		RS 13.805.725,52	
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
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
08/2021	RS 152.615,42	RS 0,00	RS 152.615,42
Saldo dos Investimentos em 08/2021		RS 16.744.921,39	

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

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	9,6797 %	5,6732 %	0,8700 %
Juros	5,4500 %	3,6011 %	0,4432 %
Meta	15,6572 %	9,4786 %	1,3171 %
Rentabilidade em %	6,9139 %	1,5519 %	-1,1624 %
Rentabilidade em RS	RS 1.015.559,02	RS 245.165,02	RS -195.132,48
Resultado em %	-7,5597 %	-7,2403 %	-2,4472 %
Resultado em RS	RS -1.282.288,84	RS -1.251.457,75	RS -416.232,74

Quadro 16.

*[Handwritten signatures and initials]*

# Relatório de Investimentos – Agosto/2021

## 4. RECURSOS DO MPE – FPREV

### 4.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/07/2021	31/08/2021	jun/21	jul/21	ago/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 7.682.757,72	R\$ 7.571.389,73	(0,0030)	(0,7756)	(1,4496)	-2,2169%	-1,5125%	-0,0077%
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 40.269.184,38	R\$ 40.066.342,19	0,3300	(0,2000)	(0,5000)	-0,3713%	-1,5000%	0,4600%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 78.277.569,54	R\$ 77.926.198,75	0,1114	(0,2496)	(0,4488)	-0,5867%	-1,3737%	0,9914%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 3.190.363,04	R\$ 3.196.056,81	(0,0900)	0,0834	0,1784	0,1717%	2,0679%	NC
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>R\$ 129.419.874,68</b>	<b>R\$ 128.759.987,48</b>						

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/07/2021	31/08/2021	jun/21	jul/21	ago/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 28.300.174,86	R\$ 27.264.879,79	0,6700	(3,7800)	(3,6600)	-6,6806%	-0,8151%	NC
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.655.395,60	R\$ 1.621.068,77	2,3200	(2,6600)	(2,0700)	-2,4634%	-1,5661%	NC
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 2.095.810,58	R\$ 3.797.602,59	-	2,5800	3,3200	5,9857%	5,9857%	NC
BB AÇÕES VALOR	R\$ 22.515.628,41	R\$ 22.108.047,88	(0,7741)	(2,3187)	(1,8102)	-4,8294%	11,8053%	NC
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$ 54.567.009,45</b>	<b>R\$ 54.791.599,03</b>						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 4.595,51	R\$ 4.311,79
<b>TOTAL RECURSOS</b>	<b>R\$ 183.991.479,64</b>	<b>R\$ 183.555.898,30</b>

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 - Ministério Público

Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
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
08/2021	R\$ 1.638.039,45	R\$ 23.802,84	R\$ 1.614.236,61
<b>Saldo dos Investimentos em 08/2020</b>			<b>R\$ 158.411.985,50</b>
<b>Saldo dos Investimentos em 08/2021</b>			<b>R\$ 183.555.898,30</b>

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

Item	Em 12 meses	No ano	No mês
Taxa de Juros Anual	5,4500%	Índice de Inflação	IPCA
IPCA	9,6797%	5,6732%	0,8700%
Juros	5,4500%	3,6011%	0,4432%
Meta	15,6572%	9,4786%	1,3171%
Rentabilidade em %	2,5745%	-0,2626%	-1,1141%
Rentabilidade em R\$	R\$ 4.318.381,07	R\$ -462.518,98	R\$ -2.049.817,95
Resultado em %	-11,3116%	-8,8978%	-2,3995%
Resultado em R\$	R\$ -21.911.198,76	R\$ -17.146.315,73	R\$ -4.473.092,04

Quadro 18.

## 5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/07/2021	31/08/2021	jun/21	jul/21	ago/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGIA	R\$ 7.841.091,54	R\$ 7.727.428,36	(0,0030)	(0,7756)	(1,4496)	-2,2169%	-1,5125%	-0,0077%	
BRADESCO INST. ALOÇ. DINAMICA	R\$ 8.568.779,63	R\$ 8.525.617,34	0,3300	(0,2000)	(0,5000)	-0,3713%	-1,5000%	0,4600%	
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 9.429.494,66	R\$ 9.373.212,22	(0,1400)	(0,0200)	0,0800	-0,0801%	0,7400%	3,7900%	
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 2.030.981,32	R\$ 2.034.605,97	(0,0935)	0,0834	0,1784	0,1682%	1,6836%	NC	
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 27.870.347,15</b>	<b>R\$ 27.660.863,89</b>							

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/07/2021	31/08/2021	jun/21	jul/21	ago/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.113.101,48	R\$ 1.090.019,84	2,3200	(2,6600)	(2,0700)	-2,4634%	-1,5661%	NC	
BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	R\$ 1.028.871,41	R\$ 991.232,58	0,6700	(3,7800)	(3,6600)	-6,6806%	-6,6806%	NC	
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 1.108.102,71	R\$ 2.327.816,67	-	2,5800	3,3200	5,9857%	5,9857%	NC	
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 16.107,53	R\$ 15.456,97	0,5100	(5,3208)	(4,0389)	-8,6814%	-0,0417%	NC	
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$ 3.266.183,13</b>	<b>R\$ 4.424.526,06</b>							

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 18.285,14
<b>TOTAL RECURSOS</b>	<b>R\$ 31.136.530,28</b>	<b>R\$ 32.103.675,09</b>

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 - Defensoria

Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
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
08/2021	R\$ 1.174.401,85	R\$ 51.465,27	R\$ 1.122.936,58
<b>Saldo dos Investimentos em 08/2020</b>			<b>R\$ 19.057.724,86</b>
<b>Saldo dos Investimentos em 08/2021</b>			<b>R\$ 32.103.675,09</b>

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

Item	Em 12 meses	No ano	No mês
Taxa de Juros Anual	5,4500%	Índice de Inflação	IPCA
IPCA	9,6797%	5,6732%	0,8700%
Juros	5,4500%	3,6011%	0,4432%
Meta	15,6572%	9,4786%	1,3171%
Rentabilidade em %	1,5725%	-0,4848%	-0,5004%
Rentabilidade em R\$	R\$ 392.919,59	R\$ -134.750,33	R\$ -155.791,77
Resultado em %	-12,1780%	-9,1008%	-1,7938%
Resultado em R\$	R\$ -3.498.088,42	R\$ -2.763.892,15	R\$ -565.877,86

Quadro 20.

# Relatório de Investimentos – Agosto/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 (%)						
	30/07/2021	31/08/2021	jun/21	jul/21	ago/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 164.029.439,57	R\$ 161.651.695,53	(0,0030)	(0,7756)	(1,4496)	-2,2169%	-1,5125%	-0,0077%	
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 51.322.171,63	R\$ 51.091.797,70	0,1114	(0,2496)	(0,4488)	-0,5867%	-1,3737%	0,9914%	
BB PREV RF IDKA 2	R\$ 166.160.343,61	R\$ 166.456.886,19	(0,0935)	0,0834	0,1784	0,1682%	1,6834%	NC	
BRANCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 41.467.572,65	R\$ 41.180.570,03	(0,1400)	(0,0200)	0,0800	-0,0801%	0,7400%	3,7900%	
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>R\$ 422.979.527,46</b>	<b>R\$ 420.380.949,45</b>							
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/07/2021	31/08/2021	jun/21	jul/21	ago/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 10.147.556,14	R\$ 9.737.711,32	0,5100	(5,3208)	(4,0389)	-8,6814%	-6,7010%	-1,0371%	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 3.613.230,59	R\$ 3.538.305,46	2,3200	(2,6600)	(2,0700)	-2,4634%	-1,5661%	NC	
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 7.295.360,16	R\$ 11.232.426,93	-	2,5800	3,3200	5,9857%	5,9857%	NC	
BRANCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 5.049.205,08	R\$ 4.864.491,85	0,6700	(3,7800)	(3,6600)	-6,6806%	-0,8153%	17,8200%	
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$ 26.105.351,97</b>	<b>R\$ 29.372.935,56</b>							
FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/07/2021	31/08/2021	jun/21	jul/21	ago/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 27.868.737,38	R\$ 28.122.318,28	(4,6145)	6,7517	0,9099	2,7522%	17,5861%	NC	
<b>TOTAL - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>	<b>R\$ 27.868.737,38</b>	<b>R\$ 28.122.318,28</b>							
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 30.998,82	R\$ 29.849,60							
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 476.984.615,63</b>	<b>R\$ 477.906.052,89</b>							

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

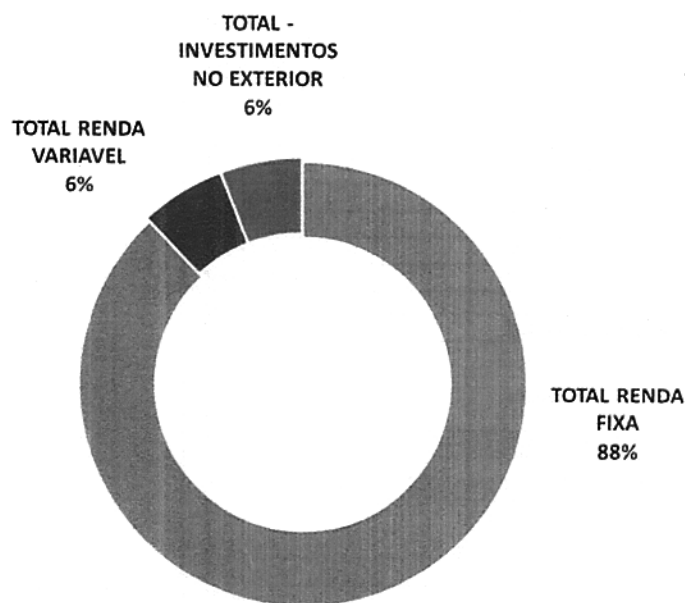


Gráfico 4.

*[Handwritten signatures and initials]*



## 6.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV

### 1. Investimentos - Tribunal de Justiça

Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
<b>Saldo dos Investimentos em 08/2020</b>			R\$ 46.540.351,06
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\$ 284.979,37	R\$ 3.186.274,07
03/2021	R\$ 3.427.904,40	R\$ 367.719,45	R\$ 3.060.184,95
04/2021	R\$ 3.574.036,92	R\$ 317.977,95	R\$ 3.256.058,97
05/2021	R\$ 3.591.371,99	R\$ 308.689,08	R\$ 3.282.682,91
06/2021	R\$ 3.620.988,47	R\$ 346.178,51	R\$ 3.274.809,96
07/2021	R\$ 3.670.676,51	R\$ 315.553,25	R\$ 3.355.123,26
08/2021	R\$ 3.690.680,27	R\$ 318.681,54	R\$ 3.371.998,73
<b>Saldo dos Investimentos em 08/2021</b>			R\$ 477.906.052,89

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

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	9,6797 %	5,6732 %	0,8700 %
Juros	5,4500 %	3,6011 %	0,4432 %
Meta	15,6572 %	9,4786 %	1,3171 %
Rentabilidade em %	2,8889 %	0,0883 %	-0,5138 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 11.896.571,07	R\$ 408.354,20	R\$ -2.450.561,47
Resultado em %	-11,0398 %	-8,5773 %	-1,8070 %
Resultado em R\$	R\$ -52.245.654,35	R\$ -43.431.972,54	R\$ -8.732.724,45

Quadro 22.

*[Assinaturas]*

*[Assinaturas]*

# Relatório de Investimentos – Agosto/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 (%)						
	30/07/2021	31/08/2021	jun/21	jul/21	ago/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 42.037.795,98	R\$ 41.428.422,93	(0,0030)	(0,7756)	(1,4496)	-2,2169%	-1,5125%	-0,0077%	
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 31.077.488,23	R\$ 31.132.951,51	(0,0935)	0,0834	0,1784	0,1682%	1,6836%	5,0819%	
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 21.309.545,60	R\$ 21.213.891,74	0,1114	(0,2496)	(0,4488)	-0,5867%	-1,3737%	0,9914%	
BRDESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 7.563.026,52	R\$ 7.536.461,89	(0,1400)	(0,0200)	0,0800	-0,0801%	0,7400%	3,7900%	
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>R\$ 101.987.856,33</b>	<b>R\$ 101.311.728,07</b>							

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/07/2021	31/08/2021	jun/21	jul/21	ago/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 10.147.556,14	R\$ 9.737.711,32	0,5100	(5,3208)	(4,0389)	-8,6814%	-6,7010%	NC	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 976.158,35	R\$ 955.916,41	2,3200	(2,6600)	(2,0700)	-2,4634%	-1,5661%	NC	
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 1.041.390,32	R\$ 1.664.705,39	-	2,5800	3,3238	5,9896%	5,9896%	NC	
BRDESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 536.991,40	R\$ 517.346,84	0,6700	(3,7800)	(3,6600)	-6,6806%	5,8478%	NC	
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$ 12.702.096,21</b>	<b>R\$ 12.875.679,96</b>							

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/07/2021	31/08/2021	jun/21	jul/21	ago/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 533.006,62	R\$ 537.856,51	(4,6145)	6,7517	0,9099	2,7522%	5,5985%	NC	
<b>TOTAL - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>	<b>R\$ 533.006,62</b>	<b>R\$ 537.856,51</b>							

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 7.463,96	R\$ 7.463,96						
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 115.230.423,12</b>	<b>R\$ 114.732.728,50</b>						

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

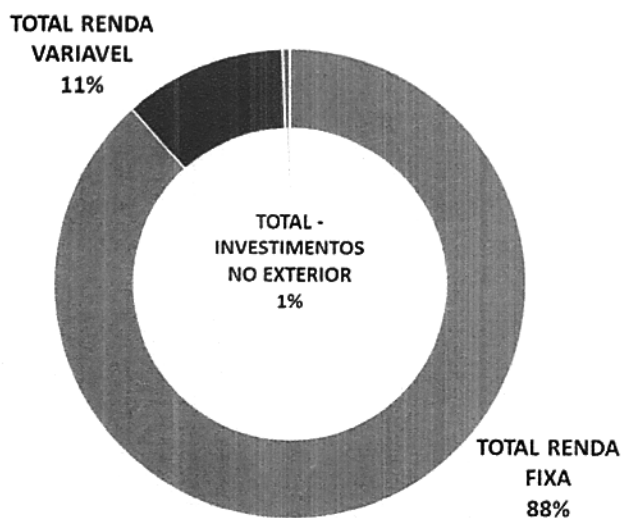


Gráfico 5.

*[Assinaturas manuscritas]*

## 7.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV

### 1. Investimentos - Tribunal de Contas

Saldo dos Investimentos em 08/2020		RS 7.876.745,09	
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
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
08/2021	RS 587.761,57	RS 32.116,97	RS 555.644,60
Saldo dos Investimentos em 08/2021		RS 114.732.728,50	

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

Taxa de Juros Anual	5,4500 %		Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês	
IPCA	9,6797 %	5,6732 %	0,8700 %	
Juros	5,4500 %	3,6011 %	0,4432 %	
Meta	15,6572 %	9,4786 %	1,3171 %	
Rentabilidade em %	1,5655 %	-1,0771 %	-0,9141 %	
Rentabilidade em RS	RS 1.586.420,57	RS -1.222.999,81	RS -1.053.339,22	
Resultado em %	-12,1840 %	-9,6417 %	-2,2022 %	
Resultado em RS	RS -14.190.311,71	RS -11.982.415,90	RS -2.570.990,47	

Quadro 24.

W B

D

[Handwritten signatures]

# Relatório de Investimentos – Agosto/2021

## 8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV

### 1. Investimentos - CONSOLIDADO

Saldo dos Investimentos em 08/2020		RS 5.043.328.020,60	
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
09/2020	RS 522.856.507,35	RS 110.053.586,29	RS 412.802.921,06
10/2020	RS 45.395.118,01	RS 112.503.349,21	RS -67.108.231,20
11/2020	RS 46.902.795,82	RS 116.701.131,09	RS -69.798.335,27
12/2020	RS 129.523.150,14	RS 176.448.361,04	RS -46.925.210,90
01/2021	RS 7.353.548,08	RS 82.470.359,61	RS -75.116.811,53
02/2021	RS 48.107.390,60	RS 45.312.469,30	RS 2.794.921,30
03/2021	RS 48.138.137,76	RS 11.102.576,72	RS 37.035.561,04
04/2021	RS 47.625.538,29	RS 10.441.370,66	RS 37.184.167,63
05/2021	RS 48.721.181,28	RS 14.868.417,77	RS 33.852.763,51
06/2021	RS 57.352.219,15	RS 11.054.322,46	RS 46.297.896,69
07/2021	RS 54.658.695,67	RS 10.359.164,41	RS 44.299.531,26
08/2021	RS 33.695.213,22	RS 11.820.129,43	RS 21.875.083,79
Saldo dos Investimentos em 08/2021		RS 5.853.799.247,78	

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

Taxa de Juros Anual	5,4500 %		Índice de Inflação	IPCA	
Item	Em 12 meses	No ano	No mês		
IPCA	9,6797 %	5,6732 %	0,8700 %		
Juros	5,4500 %	3,6011 %	0,4432 %		
Meta	15,6572 %	9,4786 %	1,3171 %		
Rentabilidade em %	8,1953 %	2,2264 %	-0,8074 %		
Rentabilidade em RS	RS 433.276.969,80	RS 124.426.003,56	RS -47.473.087,89		
Resultado em %	-6,4517 %	-6,6243 %	-2,0969 %		
Resultado em RS	RS -394.426.622,38	RS -405.201.190,73	RS -124.908.146,73		

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 GERAF/COFIN, para o exercício de 2021.

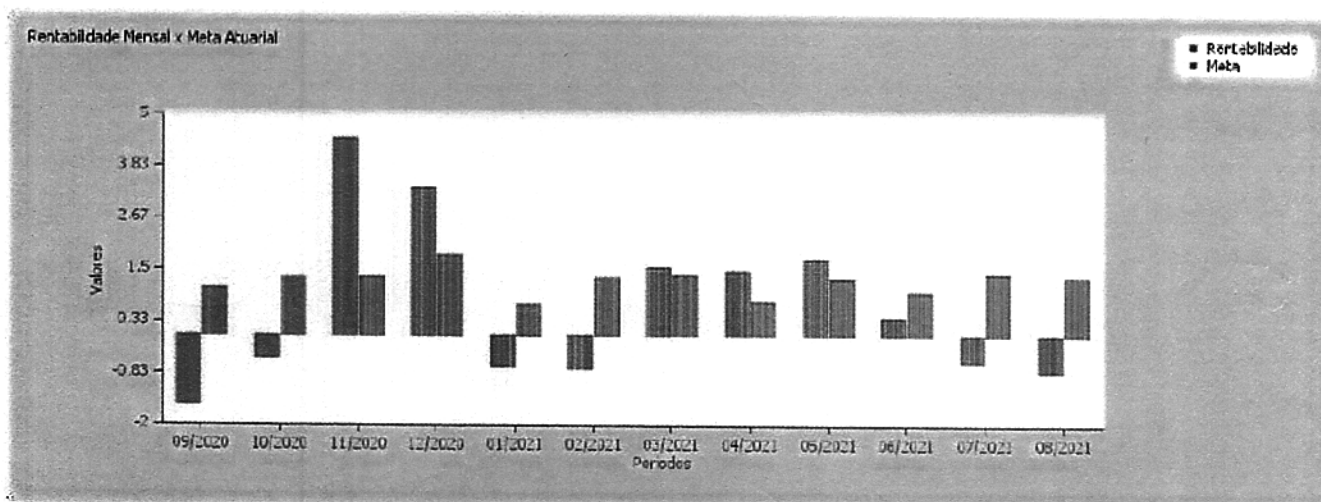


Gráfico 6.

*(Assinaturas manuscritas)*

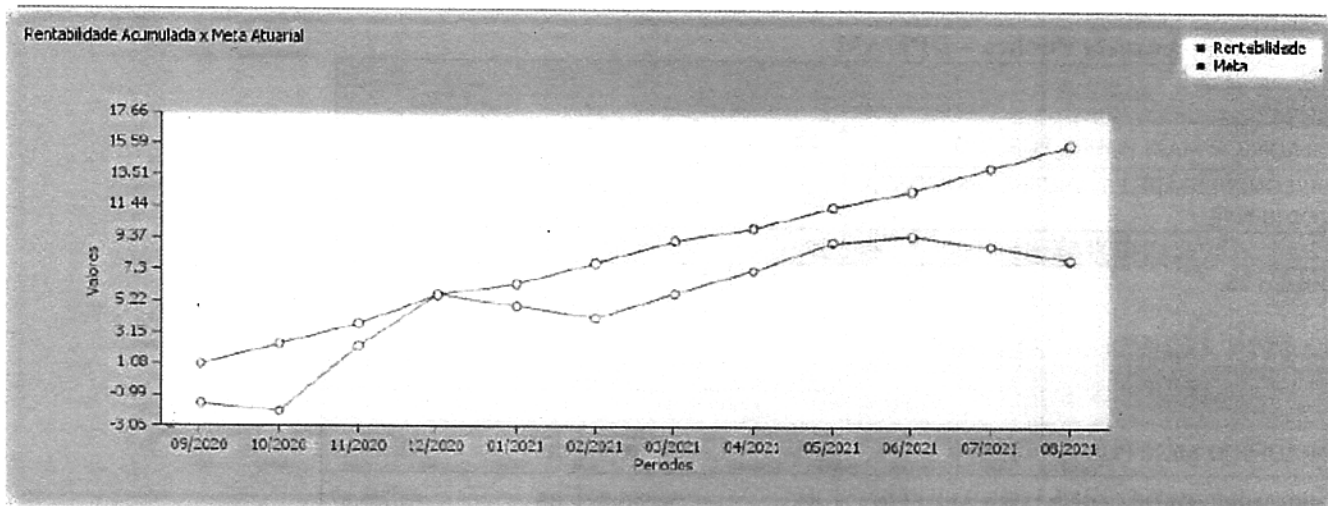


Gráfico 7.

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

### 9.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/07/2021	31/08/2021
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 9.980.303,01	R\$ 1.408.660,37
FUNDO BRADESCO RF - COMPREV	R\$ 5.779.948,02	R\$ 5.891.644,37
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 0,02	R\$ 0,02
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 13.496.627,63	R\$ 13.552.100,38
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 296.144,63	R\$ 266.529,44
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 52,00	R\$ 4.698,02
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 29.553.075,31</b>	<b>R\$ 21.123.632,60</b>

Quadro 26.

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

### 9.2 FPPM – Fundo de Proteção Previdenciária dos Militares

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/07/2021	31/08/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R\$ -	R\$ -
BRADESCO DI PREMIUM - FPPM	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R\$ 27.968,98	R\$ 1.944,20
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ 10.073,15	R\$ 10.073,15

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.

## Relatório de Investimentos – Agosto/2021

### 9.3 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/07/2021	31/08/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 214,37	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 214,37</b>	<b>R\$ -</b>

Quadro 28.

### 9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/07/2021	31/08/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 431.306,09	R\$ 433.028,15
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 56.909,89	R\$ 63.758,87
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 2.182,48
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 488.216,98</b>	<b>R\$ 498.969,50</b>

Quadro 29.

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/07/2021	31/08/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 806.993,39	R\$ 810.362,09
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ 214.061,29	R\$ 211.751,43
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 38.602,37
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 1.021.054,68</b>	<b>R\$ 1.060.715,89</b>

Quadro 30.

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/07/2021	31/08/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 6.235.542,66	R\$ 6.232.908,06
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	R\$ 561.329,82	R\$ 559.450,60
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 6.796.873,48</b>	<b>R\$ 6.792.359,66</b>

Quadro 31.

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/07/2021	31/08/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.205.946,01	R\$ 1.339.819,40
DISPONIBILIDADE COBERTURA TCE FFIN	R\$ 882.606,72	R\$ 1.005.485,09
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 2.088.552,73</b>	<b>R\$ 2.345.304,49</b>

Quadro 32.

Handwritten signatures and initials are present at the bottom of the page, including a large signature on the left, several initials in the center, and a circled 'w' on the right.

**10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO**

**10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO**

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/07/2021	31/08/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 5.058.179,35	R\$ 4.402.504,76
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 49.043.267,43	R\$ 48.332.344,21
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 296,99	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 54.101.743,77</b>	<b>R\$ 52.734.848,97</b>

Quadro 33.

**10.2 Taxa de Administração - ALE**

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/07/2021	31/08/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 36.125,32	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 36.125,32</b>	<b>R\$ -</b>

Quadro 34.

**10.3 Taxa de Administração - TCE**

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/07/2021	31/08/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 32.074,46	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 32.074,46</b>	<b>R\$ -</b>

Quadro 35.

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/07/2021	31/08/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 153.335,32	R\$ 153.975,40
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 153.543,02
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 153.335,32</b>	<b>R\$ 307.518,42</b>

Quadro 36.

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/07/2021	31/08/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 72.180,99	R\$ 144.453,59
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 72.180,99</b>	<b>R\$ 144.453,59</b>

<b>TOTAL GERAL</b>	<b>R\$ 54.395.459,86</b>	<b>R\$ 53.186.820,98</b>
--------------------	--------------------------	--------------------------

Quadro 37.

*[Handwritten signatures and initials]*

# Relatório de Investimentos – Agosto/2021

## 11. ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2021		Resolução CMN n° 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
TÍTULOS DO TESOUREIRO NACIONAL	RS 715.970.041,79	12,52%	10,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
<b>TOTAL art. 7º, inciso I, "a"</b>	<b>RS 715.970.041,79</b>				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	RS 6.903.508,85	37,13%	22,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	RS 495.301.218,57				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	RS 478.165.994,06				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	RS 51.974.456,22				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	RS 792.453.134,53				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	RS 101.598.955,76				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	RS 113.883.345,17				
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	RS 82.295.198,55				
<b>TOTAL art. 7º, inciso I, "b"</b>	<b>RS 2.122.575.811,71</b>				
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO	RS 17.449.567,70	10,49%	13,00%	40,00%	art. 7º, inciso IV, "a"
BRADERCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	RS 5.651.180,10				
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	RS 58.090.244,14				
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	RS 48.591.959,53				
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	RS 469.615.302,02				
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	RS 109.813,46				
<b>TOTAL art. 7º, inciso IV, "a"</b>	<b>RS 599.508.066,95</b>				
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	RS 30.443.279,48	0,53%	3,00%	5,00%	art. 7º, inciso VII, "b"
<b>TOTAL art. 7º, inciso VII, "b"</b>	<b>RS 30.443.279,48</b>				
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>RS 3.468.497.199,93</b>	<b>60,67%</b>			

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 n° 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BRADERCO INST IBR X ALPHA	RS 33.637.951,06	0,59%	3,00%	30,00%	art. 8º, inciso I, "a"
<b>TOTAL art. 8º, inciso I, "a"</b>	<b>RS 33.637.951,06</b>				
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	RS 40.109.943,84	25,39%	30,00%	30,00%	art. 8º, inciso II, "a"
BRADERCO FIA MID SMALL CAPS	RS 180.950.260,02				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	RS 129.252.382,44				
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	RS 24.306.534,39				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	RS 183.250.047,82				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	RS 121.331.358,38				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	RS 515.096,48				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	RS 311.784.021,62				
SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	RS 14.949,19				
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	RS 87.074.310,93				
OCCAM FIC FIA	RS 131.348.845,05				
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	RS 110.567.540,40				
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	RS 33.037.251,68				
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	RS 58.763.492,76				
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	RS 9.367.603,53				
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	RS 20.625.459,21				
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	RS 9.353.806,68				
<b>TOTAL art. 8º, inciso II, "a"</b>	<b>RS 1.451.652.904,42</b>				
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	RS 45.390.267,26	2,58%	3,00%	3,00%	art. 8º, inciso III
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	RS 101.869.098,39				
<b>TOTAL art. 8º, inciso III</b>	<b>RS 147.259.365,65</b>				
BTG ECONOMIA REAL FIP	RS 13.593.912,65	0,40%	2,00%	5,00%	art. 8º, inciso IV, "a"
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	RS 9.489.877,60				
<b>TOTAL art. 8º, inciso IV, "a"</b>	<b>RS 23.083.790,25</b>				
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>RS 1.655.634.011,38</b>	<b>28,96%</b>			

Quadro 39.



11.3 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Investimentos no Exterior

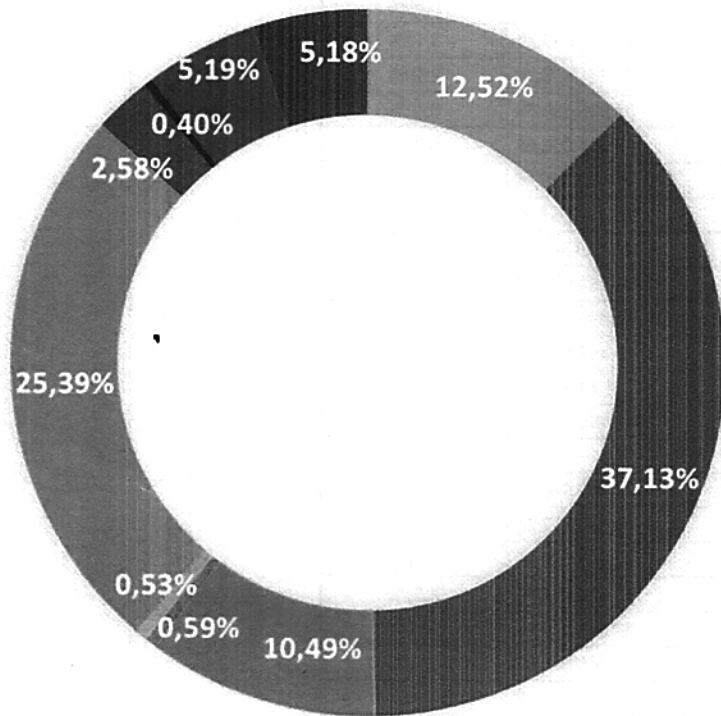
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 51.742.791,60	5,19%	5,00%	10,00%	art 9º-A, inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXTERIOR	R\$ 142.748.664,51				
SCHRODER SUSTENT AÇÕES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 29.753.755,74				
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 36.163.559,47				
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 36.087.222,99				
<b>TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior</b>	<b>R\$ 296.495.994,31</b>				
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 148.366.133,69	5,18%	5,00%		art 9º-A, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 147.843.861,95				
<b>TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I</b>	<b>R\$ 296.209.995,64</b>				
<b>TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>	<b>R\$ 592.705.989,95</b>	<b>10,37%</b>			

<b>TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES</b>	<b>R\$ 5.716.837.201,26</b>	<b>100%</b>
-----------------------------------	-----------------------------	-------------

Quadro 40.

ALOCAÇÃO TOTAL DA CARTEIRA



- TOTAL art. 7º, inciso I, "a"
- TOTAL art. 7º, inciso I, "b"
- TOTAL art. 7º, inciso IV, "a"
- TOTAL art 7º, inciso VII, "b"
- TOTAL art 8º, inciso I, "a"
- TOTAL art. 8º, inciso II, "a"
- TOTAL art. 8º, inciso III
- TOTAL art. 8º, inciso IV, "a"
- TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior
- TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I

Gráfico 8.

Handwritten signatures and initials at the bottom of the page.

## Relatório de Investimentos – Agosto/2021

### 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\$ 6.903.508,85	0,12%	20%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 495.301.218,57	8,56%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 469.615.302,02	8,11%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 129.252.382,44	2,23%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 148.366.133,69	2,56%	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 51.742.791,60	0,89%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 478.165.994,06	8,26%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 51.974.456,22	0,90%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 17.449.567,70	0,30%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 5.651.180,10	0,10%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.090.244,14	1,00%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 48.591.959,53	0,84%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 33.637.951,06	0,58%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 180.950.260,02	3,13%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 109.813,46	0,00%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 792.453.134,53	13,69%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 40.109.943,84	0,69%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 183.250.047,82	3,17%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 121.331.358,38	2,10%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 24.306.534,39	0,42%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 515.096,48	0,01%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 30.443.279,48	0,53%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 101.598.955,76	1,76%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 113.883.345,17	1,97%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 311.784.021,62	5,39%	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 13.593.912,65	0,23%	
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.489.877,60	0,16%	
SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 14.949,19	0,00%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 142.748.664,51	2,47%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ -	0,00%	
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 110.567.540,40	1,91%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 45.390.267,26	0,78%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 82.295.198,55	1,42%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 147.843.861,95	2,55%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 87.074.310,93	1,50%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 131.348.845,05	2,27%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 33.037.251,68	0,57%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 9.367.603,53	0,16%	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 36.163.559,47	0,62%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 36.087.222,99	0,62%	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 58.763.492,76	1,02%	
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 101.869.098,39	1,76%	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 9.353.806,68	0,16%	
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 20.625.459,21	0,36%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 29.753.755,74	0,51%	
<b>TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO</b>	<b>R\$ 5.000.867.159,47</b>		

Quadro 41.

**Nota: Enquadramento II Limite por fundo de Investimento - Art. 13.** As aplicações em cotas de um mesmo fundo de investimento não podem exceder a 20% (vinte por cento) das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social.

# Relatório de Investimentos – Agosto/2021

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

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14	TOTAL APLICADO	CNPJ	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL DO FUNDO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	R\$ 6.903.508,85	19.523.305/0001-06	R\$ 240.484.283,62	2,87%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDK A 2	R\$ 495.301.218,57	13.322.205/0001-35	R\$ 9.863.752.148,95	5,02%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 469.615.302,02	25.078.994/0001-90	R\$ 8.803.716.462,70	5,33%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 129.252.382,44	29.258.294/0001-38	R\$ 1.165.304.307,75	11,09%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 148.366.133,69	21.470.644/0001-13	R\$ 1.785.522.167,06	8,31%	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 51.742.791,60	17.413.636/0001-68	R\$ 2.239.794.062,67	2,31%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 17.449.567,70	08.246.263/0001-97	R\$ 882.739.880,68	1,98%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 5.651.180,10	03.399.411/0001-90	R\$ 3.865.180.591,77	0,15%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.090.244,14	20.216.216/0001/04	R\$ 1.164.277.281,46	4,99%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 48.591.959,53	28.515.874/0001-09	R\$ 1.351.295.808,04	3,60%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 33.637.951,06	14.099.976/0001-78	R\$ 584.740.914,40	5,75%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 180.950.260,02	06.988.623/0001-09	R\$ 2.170.284.029,75	8,34%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 478.165.994,06	11.060.913/0001-10	R\$ 11.104.044.700,20	4,31%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 51.974.456,22	22.791.074/0001-26	R\$ 212.106.761,55	24,50%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 792.453.134,53	23.215.097/0001-55	R\$ 15.341.053.159,31	5,17%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 24.306.534,39	10.577.512/0001-79	R\$ 418.048.583,42	5,81%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 109.813,46	21.838.150/0001-49	R\$ 3.275.640.848,90	0,00%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 40.109.943,84	08.817.414/0001-10	R\$ 984.203.936,75	4,08%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 183.250.047,82	24.571.992/0001-75	R\$ 3.356.109.147,78	5,46%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 121.331.358,38	01.063.897/0001-65	R\$ 1.417.939.968,38	8,56%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 14.949,19	02.436.763/0001-05	R\$ 1.195.949.184,16	0,00%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 142.748.664,51	17.804.792/0001-50	R\$ 1.973.726.587,17	7,23%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 130.555.414,67	08.279.304/0001-41	R\$ 1.303.812.974,47	10,01%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 101.598.955,76	10.922.432/0001-03	R\$ 1.017.145.285,28	9,99%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 113.883.345,17	10.756.541/0001-06	R\$ 791.240.314,08	14,39%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 82.580.457,04	30.659.168/0001-74	R\$ 1.353.651.560,76	6,10%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 311.784.021,62	11.977.794/0001-64	R\$ 2.748.098.825,53	11,35%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 147.843.861,95	19.436.818/0001-80	R\$ 3.440.944.721,55	4,30%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 87.074.310,93	34.791.108/0001-61	R\$ 2.227.299.560,63	3,91%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 131.348.845,05	11.628.883/0001-03	R\$ 1.191.393.271,47	11,02%	
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 110.567.540,40	28.470.587/0001-11	R\$ 1.640.952.244,33	6,74%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 33.037.251,68	11.458.144/0001-02	R\$ 660.464.359,27	5,00%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ -	15.603.945/0001-75	R\$ 605.400.421,31	0,00%	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 36.163.559,47	37.331.285/0001-53	R\$ 116.913.857.462,76	0,03%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 36.087.222,99	37.331.299/0001-77	R\$ 37.995.566.069,76	0,09%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 9.367.603,53	09.290.813/0001-38	R\$ 99.965.416,92	9,37%	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 9.353.806,68	12.239.939/0001-92	R\$ 305.220.195,92	3,06%	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 58.763.492,76	40.129.641/0001-65	R\$ 682.148.581,22	8,61%	
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 20.625.459,21	13.155.995/0001-01	R\$ 187.621.708,70	10,99%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 29.753.755,74	37.308.394/0001-50	R\$ 13.323.296.578,33	0,22%	
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 4.930.406.300,77</b>				

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14, § 1º	TOTAL APLICADO	CNPJ	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Resolução CMN nº 3.922/2010
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 46.012.835,49	21.595.829/0001-54	R\$ 1.823.132.593,52	2,52%	5%
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 101.869.098,39	26.269.692/0001-61	R\$ 2.487.417.356,50	4,10%	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 13.593.912,65	35.640.811/0001-31	R\$ 976.797.651,50	1,39%	
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.489.877,60	36.642.497/0001-99	R\$ 189.848.151,53	5,00%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 30.443.279,48	19.719.727/0001-51	R\$ 1.044.038.703,70	2,92%	
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 201.409.003,61</b>				

<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 5.131.815.304,38</b>
--------------	-----------------------------

Quadro 42.

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

## Relatório de Investimentos – Agosto/2021

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

**Nota 3:** Art. 14 § 3º. Em caso de os limites de que tratam o caput e o § 1º deste artigo serem ultrapassados em decorrência de resgate de cotas do fundo por outros cotistas, o regime próprio de previdência social deverá adequar-se em até 120 dias. 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 JULHO/2021) EM R\$ MI	TOTAL DE RECURSOS - ANBIMA	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (AGOSTO/2021)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN n° 3.922/2010
CAIXA	R\$ 434.770,27	R\$ 434.770.270.508,98	R\$ 1.346.900.119,20	0,3098%	5%
BB DTVM S.A	R\$ 1.327.825,65	R\$ 1.327.825.646.227,96	R\$ 1.301.181.337,17	0,0980%	
BRDESCO	R\$ 538.552,43	R\$ 538.552.432.629,72	R\$ 344.371.162,55	0,0639%	
ICATÚ VANGUARDA DTVM S/A	R\$ 34.024,41	R\$ 34.024.411.994,76	R\$ 246.440.676,89	0,7243%	
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 754.073,57	R\$ 754.073.567.573,15	R\$ 446.670.261,89	0,0592%	
BANCO BTG	R\$ 220.689,05	R\$ 220.689.050.650,19	R\$ 344.235.415,40	0,1560%	
BANCO SAFRA	R\$ 107.135,57	R\$ 107.135.573.213,15	R\$ 275.529.327,76	0,2572%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	R\$ 299.231,06	R\$ 299.231.060.636,72	R\$ 142.763.613,70	0,0477%	
OCCAM BRASIL GESTÃO	R\$ 16.154,27	R\$ 16.154.271.032,15	R\$ 131.348.845,05	0,8131%	
AZ QUEST INVESTIMENTOS	R\$ 15.869,57	R\$ 15.869.572.434,45	R\$ 87.074.310,93	0,5487%	
PLURAL INVEST GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 33.044,58	R\$ 33.044.581.104,99	R\$ 72.250.782,46	0,2186%	
SULAMERICA INVESTIMENTOS	R\$ 27.554,10	R\$ 27.554.095.760,23	R\$ 33.037.251,68	0,1199%	
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL LTDA	R\$ 26.740,40	R\$ 26.740.398.617,73	R\$ 29.753.755,74	0,1113%	
VINCI PARTNERS	R\$ 42.447,28	R\$ 42.447.277.723,87	R\$ 110.567.540,40	0,2605%	
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	R\$ 57.912,17	R\$ 57.912.172.551,10	R\$ 9.353.806,68	0,0162%	
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT ADM REC LTDA	R\$ 7.181,97	R\$ 7.181.967.551,90	R\$ 20.625.459,21	0,2872%	
BC GESTAO RECURSOS LTDA	R\$ 9.344,88	R\$ 9.344.876.385,43	R\$ 58.763.492,76	0,6288%	

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

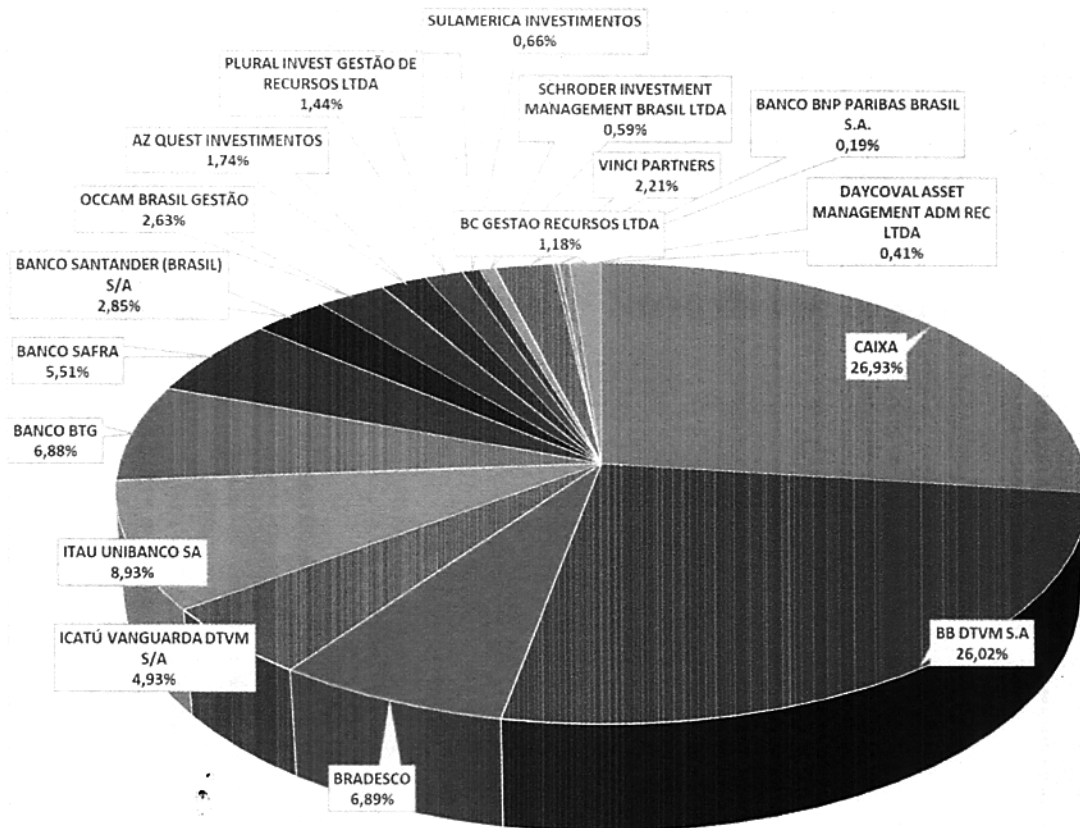


Gráfico 9.

*[Handwritten signature]*

*[Handwritten signatures]*

## Relatório de Investimentos – Agosto/2021

### 12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 5.131.815.304,37
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 711.950.295,29
TÍTULOS - CVS	R\$ 9.288.117,84
IMÓVEIS	R\$ 61.835.325,18
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ 8.000.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 15.930.031,56
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 5.938.819.074,24</b>

Quadro 44.

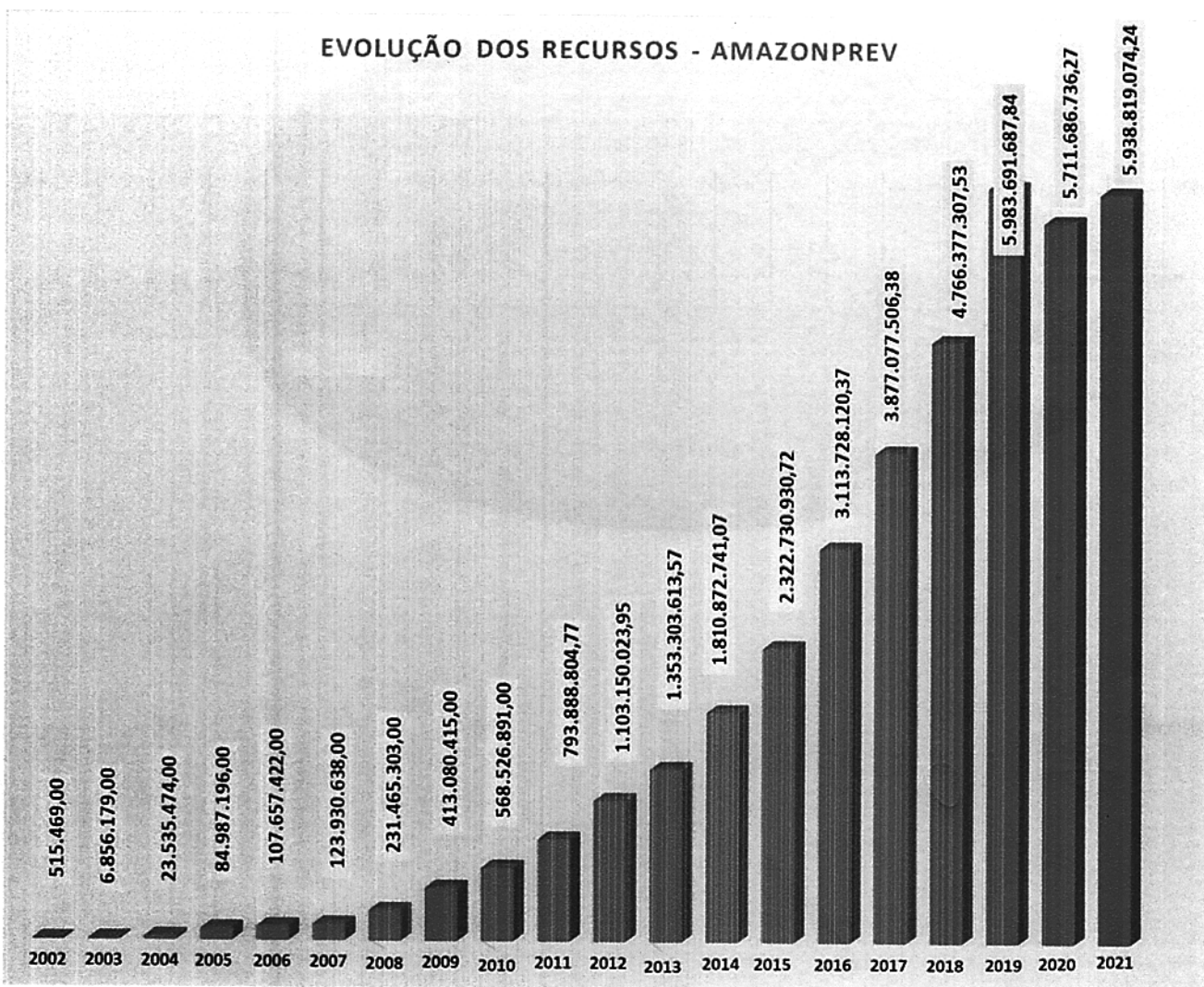


Gráfico 10.

*[Handwritten signatures and initials]*

**13. PLANO DE AÇÃO MENSAL**

	PLANO DE AÇÃO MENSAL	RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV EXECUTIVO:	a) Novos Recursos: Ratear entre os fundos SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF (30.659.168/0001-74) MONGERAL AEGON CP FI RF LP (19.488.768/0001-84); SANTANDER RF CP CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP (17.138.474/0001-05); ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC FI (09.093.883/0001-04); BTG PACTUAL CP I FIC DE FI RF CP (: 14.171.644/0001-57)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2021
FPREV ALE:	Novos Recursos: Direcionar para o fundo SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO (21.595.829/0001-54)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2021
FPREV MPE/PGJ:	Novos Recursos: Direcionar para o fundo SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO (21.595.829/0001-54)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2021
FPREV - DPE/AM	Novos Recursos: Direcionar para o fundo SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO (21.595.829/0001-54)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2021
FPREV - TJ/AM	Novos Recursos: Direcionar para o fundo SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO (21.595.829/0001-54)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2021
FPREV - TCE/AM	Novos Recursos: Direcionar para o fundo SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO (21.595.829/0001-54)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2021
FFIN (Executivo, ALE, TCE, TJA, MPE, DPE, FPPM)	Aplicar os recursos no fundo Bradesco Maxi Poder Público, facilitando a operacionalização dos pagamentos das folhas de inativos e pensionistas desses órgãos. Devem ser observados os limites para aplicação conforme legislação vigente.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2021
RECURSOS COMPREV	Aplicar os recursos no fundo Bradesco Maxi Poder Público.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2021
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	15/10/2021

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 – Agosto/2021

AMAZONPREV  
Folha nº 018  
*[Handwritten Signature]*

TOTAL RENDA FIXA	R\$	3.395.613.011,52
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$	1.777.136.760,33
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$	592.705.989,95
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$	5.765.455.761,80

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso I, "a"	art.	Data da Últ Cotação	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	ago/21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
TÍTULOS PÚBLICOS DO TESOUREIRO	art. 7º, inciso I, "a"		R\$ 711.950.295,29						
TOTAL - art. 7º, inciso I, "a"			R\$ 711.950.295,29						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso I, "b"	art.	Data da Últ Cotação	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	ago/21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Prev RF Tit Publ VII FI	art. 7º, inciso I, "b"	08/09/2021	R\$ 6.903.508,85	1,68%	0,17%	-0,71	6,51%	0,45%	3,32%
Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	art. 7º, inciso I, "b"	08/09/2021	R\$ 51.974.456,22	5,21%	0,54%	-1,85	-2,07%	-2,65%	-5,04%
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	art. 7º, inciso I, "b"	08/09/2021	R\$ 478.165.994,06	2,62%	0,27%	-1,22	4,50%	0,13%	1,30%
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	art. 7º, inciso I, "b"	08/09/2021	R\$ 744.120.790,32	2,61%	0,27%	-1,28	-0,01%	-1,45%	-1,51%
Icatu Vanguardia Inflacao Curta FI RF LP	art. 7º, inciso I, "b"	08/09/2021	R\$ 101.598.955,76	2,68%	0,28%	-1,23	4,23%	0,09%	1,13%
Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	art. 7º, inciso I, "b"	08/09/2021	R\$ 113.883.345,17	8,85%	0,91%	-4,38	1,40%	-2,31%	-5,72%
Safra Ima Institucional Fc FI RF	art. 7º, inciso I, "b"	08/09/2021	R\$ 82.580.457,04	6,79%	0,70%	-3,79	1,00%	-1,56%	-4,10%
BB Prev RF Idica 2 FI	art. 7º, inciso I, "b"	08/09/2021	R\$ 495.301.218,57	2,38%	0,25%	-1,10	5,08%	0,18%	1,68%
TOTAL - art. 7º, inciso I, "b"			R\$ 2.074.528.725,99						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso IV, "a"	art.	Data da Últ Cotação	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	ago/21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Prev RF Alocao Ativa Fcfi	art. 7º, inciso IV, "a"	08/09/2021	R\$ 469.615.302,02	2,90%	0,30%	-1,55	0,99%	-0,45%	-1,37%
Bradesco Fc FI RF Alocao Dinamica	art. 7º, inciso IV, "a"	08/09/2021	R\$ 48.591.959,53	3,10%	0,32%	-2,00	0,46%	-0,50%	-1,50%
Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	art. 7º, inciso IV, "a"	08/09/2021	R\$ 58.090.244,14	2,78%	0,29%	-1,52	3,79%	0,08%	0,74%
Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	art. 7º, inciso IV, "a"	09/09/2021	R\$ 2.283.391,61	0,33%	0,03%	-0,55	2,20%	0,42%	1,97%
Itau Instit Alocao Dinamica RF FICFI	art. 7º, inciso IV, "a"	08/09/2021	R\$ 109.813,46	0,66%	0,07%	-0,58	1,63%	0,31%	1,47%
TOTAL - art. 7º, inciso IV, "a"			R\$ 578.690.710,76						

*[Handwritten Signatures and Initials]*

# Relatório de Investimentos – Agosto/2021

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA	art.	Data da Út Cotação	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
art. 7º, inciso VII, "b"									
Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	art. 7º, inciso VII, "b"	08/09/2021	R\$ 30.443.279,48	3,28%	0,34%	-1,36	6,09%	-0,17%	2,33%
<b>TOTAL - art. 7º, inciso VII, "b"</b>			<b>R\$ 30.443.279,48</b>						
							12M	ago/21	2021
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	art.	Data da Út Cotação	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
art. 8º, inciso I, "a"									
Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	art. 8º, inciso I, "a"	08/09/2021	R\$ 33.637.951,06	19,66%	2,03%	-10,90	17,82%	-3,66%	-0,82%
<b>TOTAL - art. 8º, inciso I, "a"</b>			<b>R\$ 33.637.951,06</b>						
							12M	ago/21	2021
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	art.	Data da Út Cotação	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
art. 8º, inciso II, "a"									
BB Ações Valor FICFIA	art. 8º, inciso II, "a"	08/09/2021	R\$ 129.252.382,44	20,00%	2,06%	-15,12	26,40%	-1,81%	0,25%
Bradesco FIA Mid Small Caps	art. 8º, inciso II, "a"	08/09/2021	R\$ 180.950.260,02	19,61%	2,02%	-10,17	16,33%	-2,76%	6,63%
BTG Pactual Absolute Inst FIC FIA	art. 8º, inciso II, "a"	08/09/2021	R\$ 311.784.021,62	20,38%	2,10%	-9,04	1,31%	-6,82%	-7,11%
Caixa FIA Consumo	art. 8º, inciso II, "a"	08/09/2021	R\$ 24.306.534,39	21,49%	2,22%	-10,57	-1,04%	-4,04%	-6,69%
Icatu Vanguarda Dividendos FIA	art. 8º, inciso II, "a"	08/09/2021	R\$ 130.555.414,67	17,84%	1,84%	-9,92	8,30%	-2,95%	-4,70%
Itau Acoes Dunamis Fc	art. 8º, inciso II, "a"	08/09/2021	R\$ 183.250.047,82	18,11%	1,87%	-7,78	21,25%	-2,21%	6,37%
Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	art. 8º, inciso II, "a"	08/09/2021	R\$ 40.109.943,84	19,15%	1,97%	-10,50	14,19%	-3,13%	-1,93%
Itau Institucional Acoes Phoenix Fc	art. 8º, inciso II, "a"	08/09/2021	R\$ -	21,61%	2,23%	-15,11	13,56%	-4,10%	4,76%
Itau Small Cap Master FIA	art. 8º, inciso II, "a"	08/09/2021	R\$ 121.331.358,38	20,58%	2,12%	-9,56	24,16%	-3,81%	6,34%
Sant Selecao Cresc Senior Acoes Fc FI	art. 8º, inciso II, "a"	08/09/2021	R\$ 14.949,19	19,95%	2,05%	-12,22	9,58%	-2,10%	-3,70%
Santander FI Ibovespa Ativo Inst Acoes	art. 8º, inciso II, "a"	08/09/2021	R\$ -	20,10%	2,07%	-11,97	12,68%	-2,62%	-1,73%
Sant Selecao Crescimento Acoes Fc FI	art. 8º, inciso II, "a"	08/09/2021	R\$ -	19,94%	2,05%	-12,23	9,62%	-2,11%	-3,68%
Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	art. 8º, inciso II, "a"	08/09/2021	R\$ 87.074.310,93	20,13%	2,07%	-10,73	13,08%	-5,07%	2,79%
Ocean Fc de FIA	art. 8º, inciso II, "a"	08/09/2021	R\$ 131.348.845,05	20,22%	2,08%	-12,30	13,32%	-2,44%	-2,14%
Sul America Equities FIA	art. 8º, inciso II, "a"	08/09/2021	R\$ 33.037.251,68	19,15%	1,97%	-13,38	5,96%	-3,82%	-1,84%
BTG Pactual Dividendos FIC FIA	art. 8º, inciso II, "a"	08/09/2021	R\$ 9.697.343,66	18,84%	1,94%	-9,80	6,34%	-3,40%	-4,48%
Vinci Mosaico Institucional FIA	art. 8º, inciso II, "a"	08/09/2021	R\$ 110.567.540,40	18,84%	1,94%	-10,27	16,22%	-2,20%	-1,31%
Vinci Selection Equities FIA	art. 8º, inciso II, "a"	08/09/2021	R\$ -	17,50%	1,80%	-10,60	12,60%	-2,80%	-0,29%
Brasil Capital Master 30 II FIA	art. 8º, inciso II, "a"	08/09/2021	R\$ 58.763.492,76	19,75%	2,04%	-10,06	16,61%	-1,81%	0,68%
BNP Paribas Master Acoes FI	art. 8º, inciso II, "a"	20/01/2014	R\$ 9.353.806,68						
Daycoval Ibovespa Ativo FIA	art. 8º, inciso II, "a"	08/09/2021	R\$ 20.625.459,21	20,24%	2,09%	-11,29	13,51%	-3,97%	-2,35%
<b>TOTAL - art. 8º, inciso II, "a"</b>			<b>R\$ 1.582.022.962,74</b>						
							12M	ago/21	2021
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	art.	Data da Út Cotação	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
art. 8º, inciso III									
Safrá S P Realis P5 FI Mult	art. 8º, inciso III	08/09/2021	R\$ 46.012.835,49	14,73%	1,52%	-9,70	30,12%	3,32%	22,73%
Itau Private Mult S&P500 Brl Fc	art. 8º, inciso III	08/09/2021	R\$ 101.869.098,39	14,89%	1,54%	-9,74	30,77%	3,36%	23,12%
<b>TOTAL - art. 8º, inciso III</b>			<b>R\$ 147.881.933,88</b>						
							12M	ago/21	2021
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	art.	Data da Út Cotação	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
art. 8º, inciso IV, "a"									
BTG Pactual Economia Real FIP	art. 8º, inciso IV, "a"	15/08/2014	R\$ 13.593.912,65						
<b>TOTAL - art. 8º, inciso IV, "a"</b>			<b>R\$ 13.593.912,65</b>						
							12M	ago/21	2021
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	art.	Data da Út Cotação	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
art 9º - A - II - Suíço Investimento no Exterior									
BB Mult Global Select Equity Ie FI	art 9º - A - II - Suíço Investimento no Exterior	08/09/2021	R\$ 51.742.791,60	20,22%	2,10%	-10,91	25,24%	0,91%	17,59%
Sant Global Equi Dolar Mas Mult Ie Fc FI	art 9º - A - II - Suíço Investimento no Exterior	08/09/2021	R\$ 142.748.664,51	17,79%	1,84%	-6,83	19,91%	1,31%	14,44%
Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	art 9º - A - II - Suíço Investimento no Exterior	08/09/2021	R\$ 29.753.755,74	20,40%	2,11%	-9,75	27,00%	2,02%	18,59%
Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	art 9º - A - II - Suíço Investimento no Exterior	08/09/2021	R\$ 36.087.222,99			-10,83		2,42%	10,40%
Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	art 9º - A - II - Suíço Investimento no Exterior	08/09/2021	R\$ 36.163.559,47			-10,58		0,50%	7,68%
<b>TOTAL - art 9º - A - II - Suíço Investimento no Exterior</b>			<b>R\$ 296.495.994,31</b>						
							12M	ago/21	2021
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	art.	Data da Út Cotação	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I									
BB Acoes Esg FIA - Bdr Nível I	art 9º - A - III - BDR Nível I	08/09/2021	R\$ 148.366.133,69	20,09%	2,07%	-11,63	16,25%	3,09%	17,83%
Safrá Consumo Americano FIA Bdr Nível I	art 9º - A - III - BDR Nível I	08/09/2021	R\$ 147.843.861,95	19,51%	2,01%	-10,43	18,52%	2,24%	20,01%
<b>TOTAL - TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I</b>			<b>R\$ 296.209.995,64</b>						

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

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

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

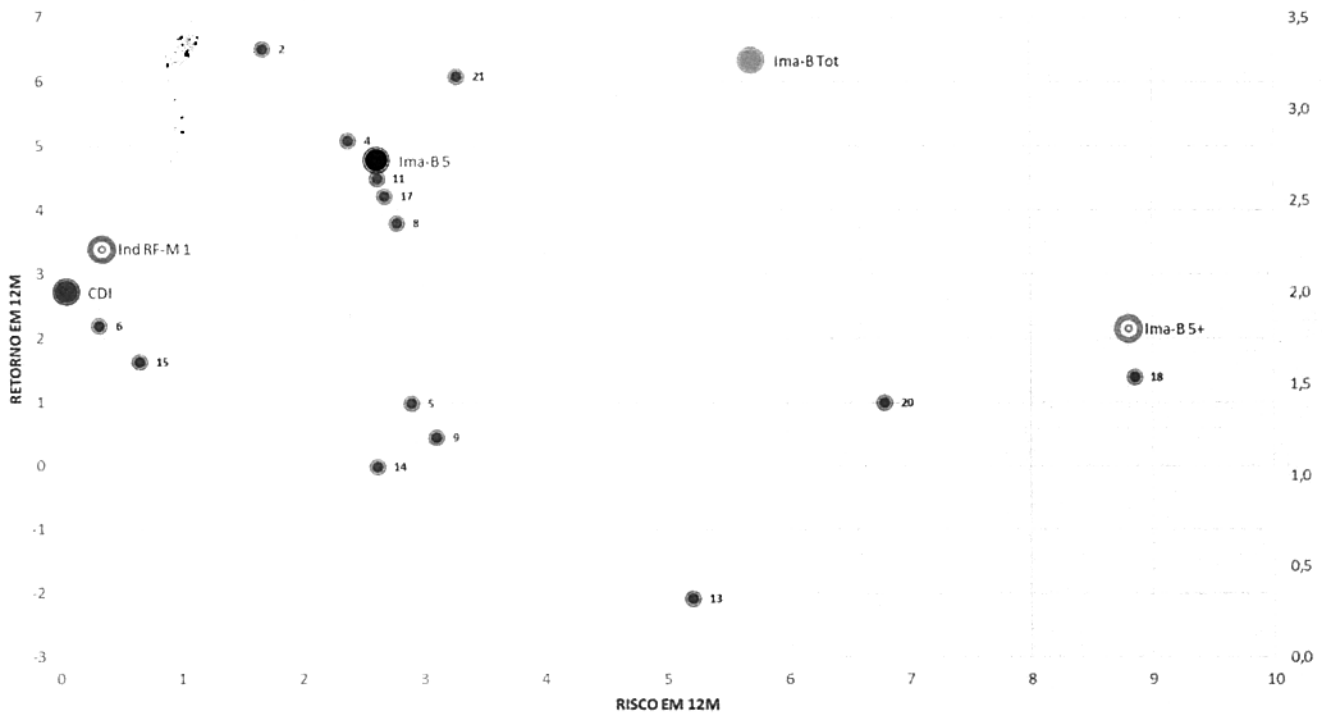


Gráfico 1: Art. 7º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

*Handwritten signatures and initials:*  
 J la  
 @  
 [Signature]  
 [Signature]

# Relatório de Investimentos – Agosto/2021

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
2	art. 7º, inciso I, "b"	BB Prev RF Tit Publ VII FI	6,51	1,68	D+000	D+000
4	art. 7º, inciso I, "b"	BB Prev RF Idka 2 FI	5,08	2,38	D+001	D+001
5	art. 7º, inciso IV, "a"	BB Prev RF Alocação Ativa Fcfl	0,99	2,90	D+003	D+003
6	art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco FI RF Maxi Poder Público	2,20	0,33	D+000	D+000
8	art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	3,79	2,78	D+001	D+001
9	art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco Fc FI RF Alocação Dinâmica	0,46	3,10	D+003	D+004
11	art. 7º, inciso I, "b"	FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	4,50	2,62	D+000	D+000
13	art. 7º, inciso I, "b"	Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	-2,07	5,21	D+000	D+000
14	art. 7º, inciso I, "b"	Caixa FIC Brasil Gestão Estratégica RF	-0,01	2,61	D+000	D+000
15	art. 7º, inciso IV, "a"	Itau Instit Alocação Dinâmica RF FICFI	1,63	0,66	D+000	D+001
17	art. 7º, inciso I, "b"	Icatu Vanguarda Inflação Curta FI RF LP	4,23	2,68	D+000	D+001
18	art. 7º, inciso I, "b"	Icatu Vang Inflação Longa FI RF LP	1,40	8,85	D+000	D+001
20	art. 7º, inciso I, "b"	Safra Ima Institucional Fc FI RF	1,00	6,79	D+003	D+004
21	art. 7º, inciso VII, "b"	Icatu Vang FI RF Inflação Cred Priv LP	6,09	3,28	D+005	D+006

Quadro 2. Legenda Gráfico 1.

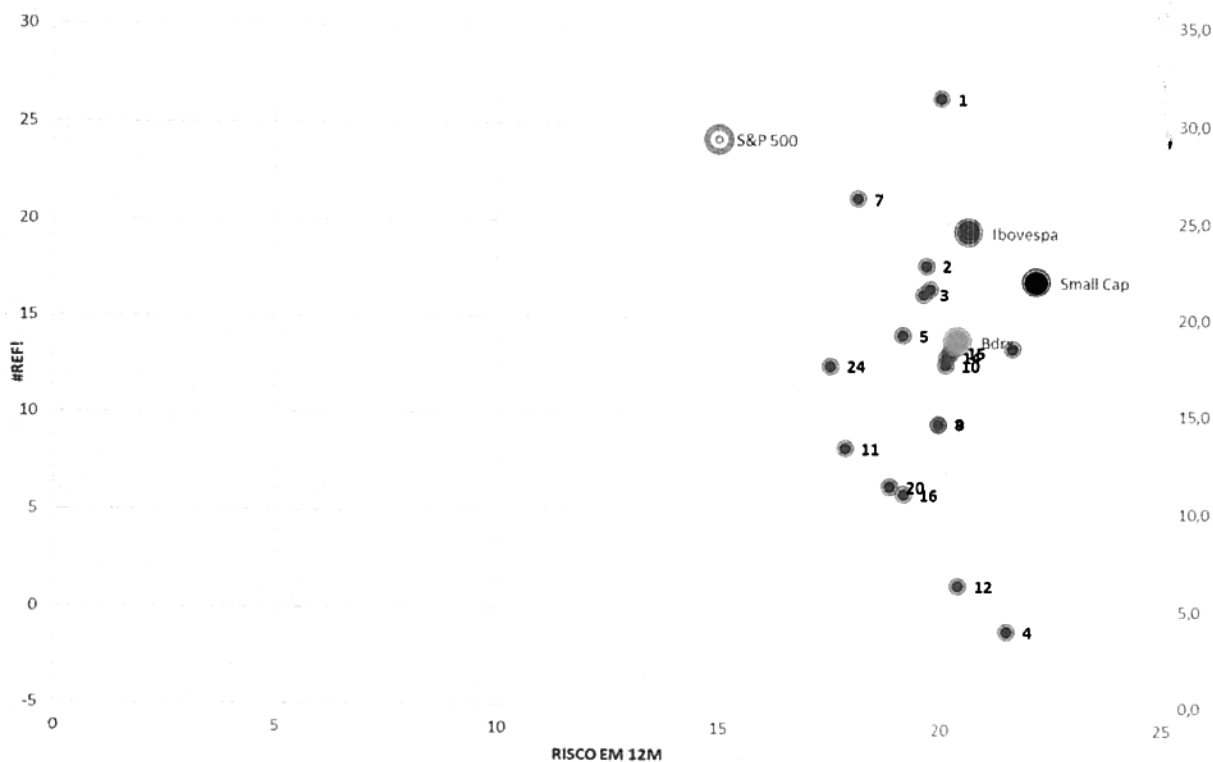


Gráfico 2: Art. 8º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

*[Handwritten signatures and initials]*

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art. 8º, inciso II, "a"	BB Ações Valor FICFIA	26,40	20,00	D+030	D+032
2	art. 8º, inciso I, "a"	Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	17,82	19,66	D+000	D+002
3	art. 8º, inciso II, "a"	Bradesco FIA Mid Small Caps	16,33	19,61	D+001	D+003
4	art. 8º, inciso II, "a"	Caixa FIA Consumo	-1,04	21,49	D+001	D+003
5	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	14,19	19,15	D+002	D+002
6	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Institucional Acoes Phoenix Fc	13,56	21,61	D+021	D+023
7	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Acoes Dunamis Fc	21,25	18,11	D+021	D+023
8	art. 8º, inciso II, "a"	Sant Selecao Crescimento Acoes Fc FI	9,62	19,94	D+027	D+029
9	art. 8º, inciso II, "a"	Sant Selecao Cresc Senior Acoes Fc FI	9,58	19,95	D+001	D+003
10	art. 8º, inciso II, "a"	Santander FI Ibovespa Ativo Inst It Acoes	12,68	20,10	D+001	D+003
11	art. 8º, inciso II, "a"	Icatu Vanguarda Dividendos FIA	8,30	17,84	D+001	D+003
12	art. 8º, inciso II, "a"	BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	1,31	20,38	D+001	D+032
14	art. 8º, inciso II, "a"	Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	13,08	20,13	D+027	D+029
15	art. 8º, inciso II, "a"	Occam Fc de FIA	13,32	20,22	D+001	D+003
16	art. 8º, inciso II, "a"	Sul America Equities FIA	5,96	19,15	D+001	D+003
20	art. 8º, inciso II, "a"	BTG Pactual Dividendos FIC FIA	6,34	18,84	D+001	D+003
24	art. 8º, inciso II, "a"	Vinci Selection Equities FIA	12,60	17,50	D+060	D+062
25	art. 8º, inciso II, "a"	Brasil Capital Master 30 II FIA	16,61	19,75	D+000	D+002
26	art. 8º, inciso II, "a"	BNP Paribas Master Acoes FI			D+000	D+003
29	art. 8º, inciso II, "a"	Daycoval Ibovespa Ativo FIA	13,51	20,24	D+012	D+014

Quadro 3. Legenda Gráfico 2.

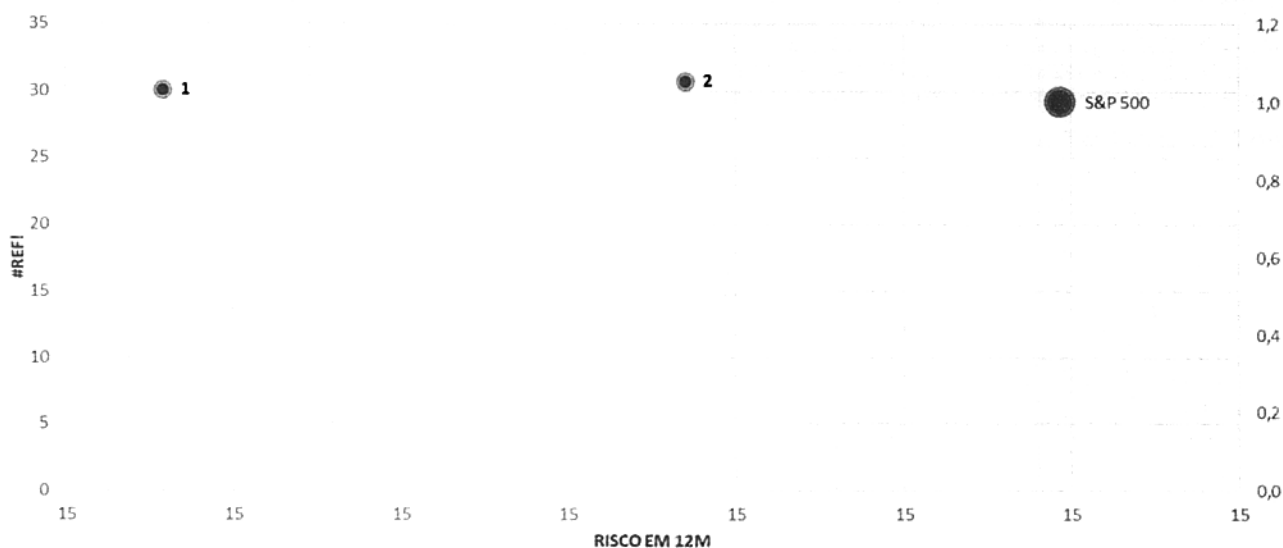


Gráfico 3: Art. 8-III,º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art. 8º, inciso III	Safra S P Reais Pb FI Mult	30,12	14,73	D+001	D+002
2	art. 8º, inciso III	Itau Private Mult S&P500 Bri Fc	30,77	14,89	D+000	D+001

Quadro 4. Legenda Gráfico 3.

Handwritten signatures and initials, including a large signature at the bottom center and several smaller ones scattered around.

# Relatório de Investimentos – Agosto/2021

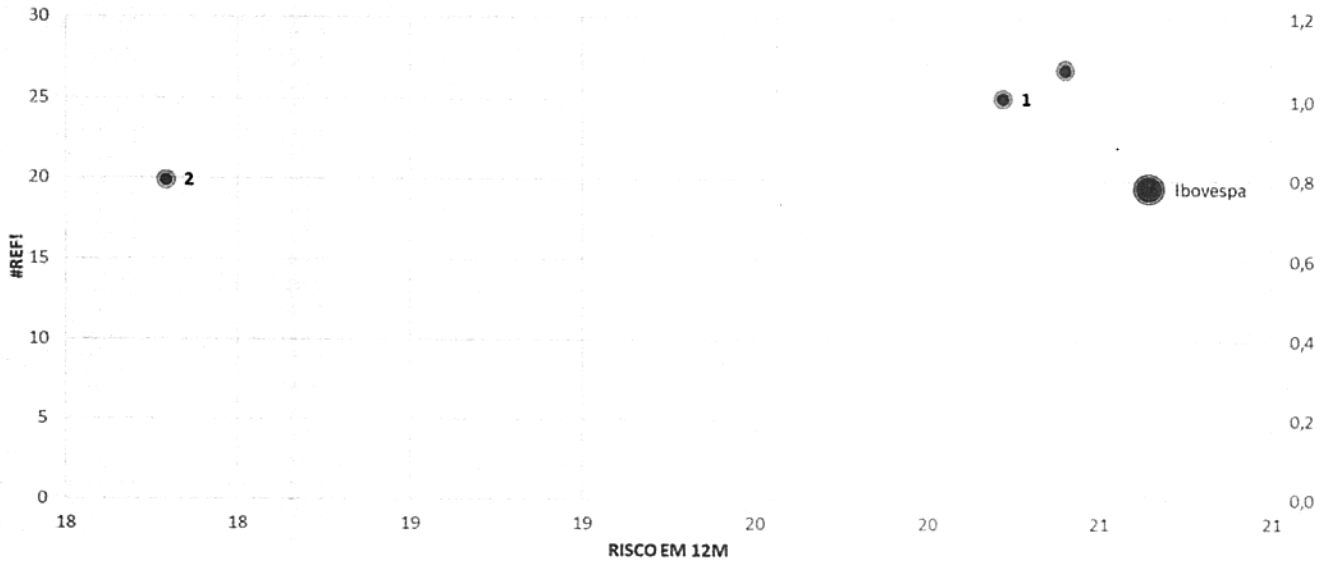


Gráfico 4: Art. 9º-A-II Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	BB Mult Global Select Equity Ie FI	25,24	20,22	D+001	D+005
2	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Sant Global Equi Dolar Mas Mult Ie Fc FI	19,91	17,79	D+001	D+008
3	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	27,00	20,40	D+001	D+004
4	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie			D+001	D+006
5	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie			D+001	D+006

Quadro 5. Legenda Gráfico 4.

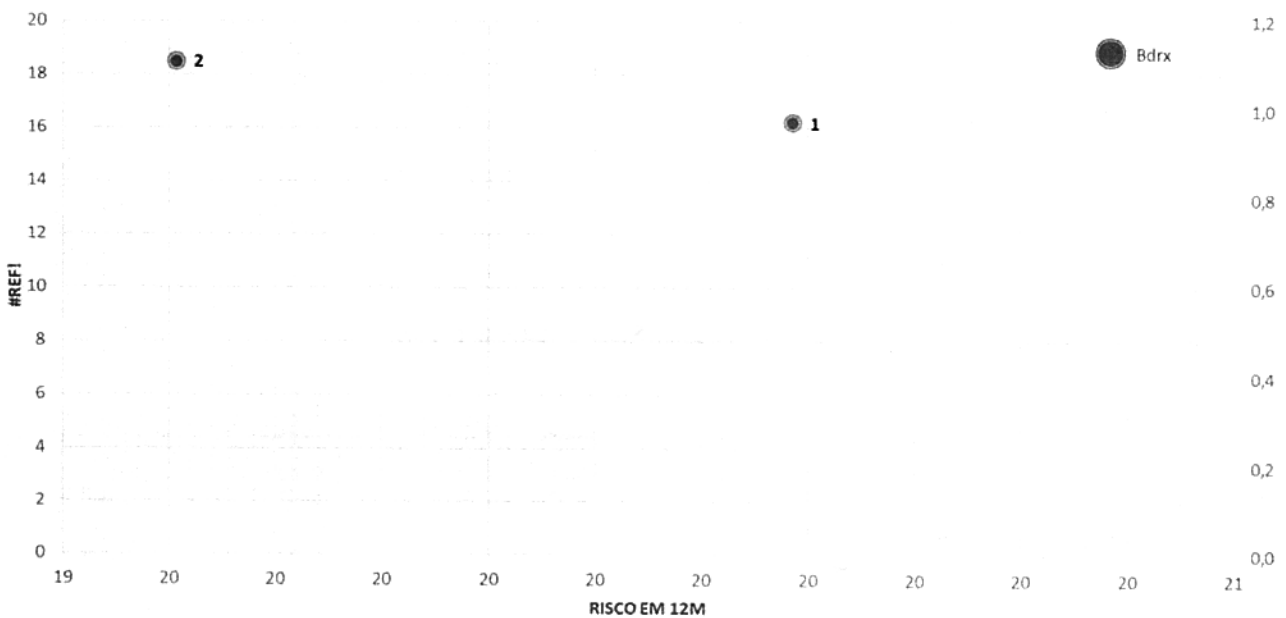


Gráfico 5: Art. 9-A-IIIº Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art 9º - A - III - BDR Nível I	BB Acoes Esg FIA - Bdr Nível I	16,25	20,09	D+001	D+004
2	art 9º - A - III - BDR Nível I	Safra Consumo Americano FIA Bdr Nível I	18,52	19,51	D+001	D+004

Quadro 6. Legenda Gráfico 5.

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

DATA BASE EM 31/08/21

TABELA - DURATION & YIELD POR CLASSE			
Ativo	Duration	Spread	% PL
DEB	3,57	1,68%	58,6%
CRI	0,00	0,00%	0,0%
LF	2,78	1,58%	15,1%
CDB	1,17	0,70%	0,0%
DPGE	0,00	0,00%	0,0%
NP	0,82	2,29%	1,0%
BOND	0,00	0,00%	0,0%
FIDC	0,00	0,00%	0,0%
NTN-B	3,93	-	13,7%
Over	0,00	-	11,7%
Carteira Crédito	3,37	1,67%	74,6%
Crédito - Contribuição Fundo	1,23	1,25%	74,6%
Fundo (Inclui DAP e NTN-B)	3,27	1,25%	100,0%

Quadro 03

TABELA - RATING EXTERNO*		
Rating	Financeiro	% PL
AAA	306.252.696	29,3%
AA+	68.522.375	6,6%
AA	141.720.022	13,6%
AA-	124.431.757	11,9%
A+	68.451.026	6,6%
DPGE	0	0,0%
A	11.125.706	1,1%
A-	16.674.875	1,6%
BBB+	0	0,0%
BBB	0	0,0%
BBB-	7.339.455	0,7%
BB+	10.261.381	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	23.917.143	2,3%
Tesouro / Over	265.423.436	25,4%
Total	1.044.119.872	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	183.809.195	17,6%
Bancos	157.242.751	15,1%
Serviço	110.914.612	10,6%
Saneamento	85.097.910	8,2%
Conc. Rodoviárias	82.735.713	7,9%
Varejo	47.722.491	4,6%
Shopping Center	29.106.567	2,8%
Infraestrutura	23.767.785	2,3%
Logística	22.098.973	2,1%
Holding	10.010.240	1,0%
Indústria e Comércio	9.769.365	0,9%
Óleo e Gás	8.269.340	0,8%
Mineração e Siderurgia	8.151.495	0,8%
Tesouro / Over	265.423.436	25,4%

Quadro 05.

Nota: Dados referentes ao fundo ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CREDITO PRIVADO LP. (base: 31/08/2021)

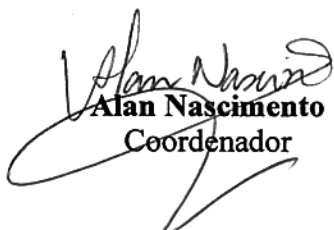
## **PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS**

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 13 de setembro de 2021, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de agosto/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.

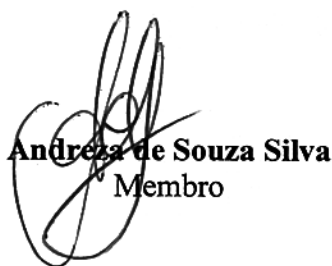
Manaus – AM, 13 de setembro de 2021.

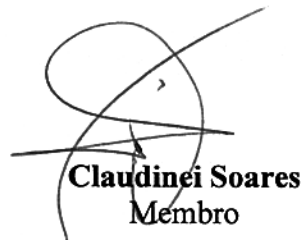
  
**Alan Nascimento**  
Coordenador

  
**Bruno Costa Novo**  
Secretário

  
**Bruno Barroso**  
Membro

  
**Leonardo Cavalcanti**  
Membro

  
**Andréa de Souza Silva**  
Membro

  
**Claudinei Soares**  
Membro

  
**André Luiz Bentes**  
Membro

  
**Marcos Souza**  
Membro