



GOVERNO DO ESTADO DO AMAZONAS



AMAZONPREV

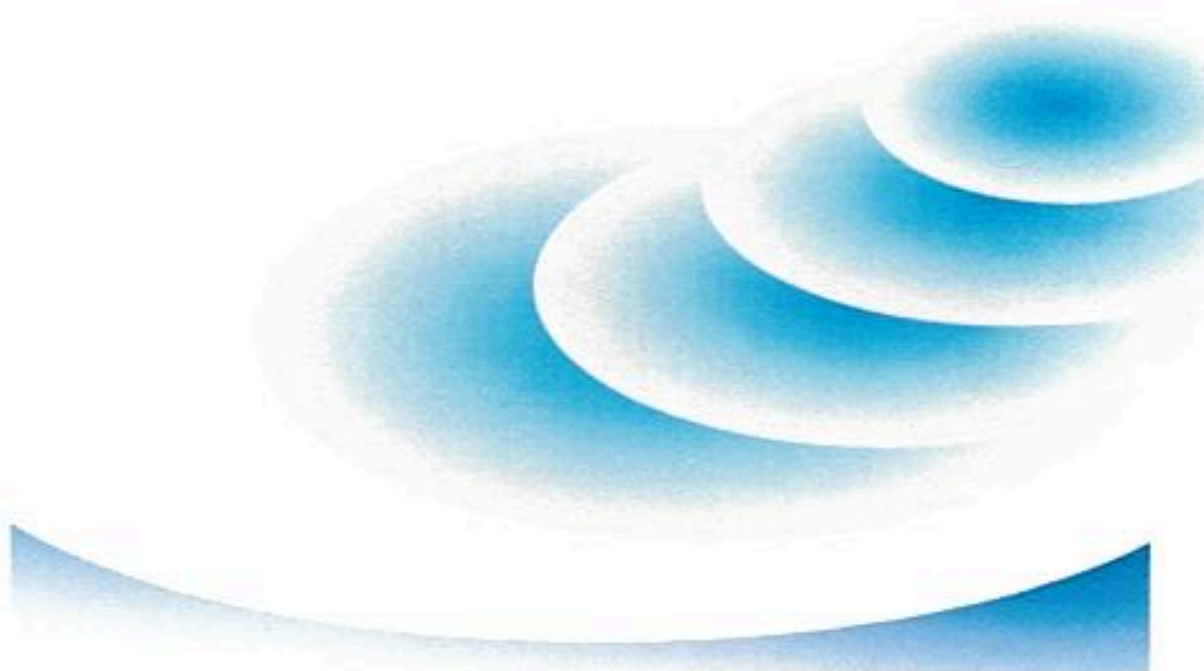
Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



RELATÓRIOS - 2020

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Dezembro / 2020



Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

Destino: DIRAF / PRESI

Assunto: **Relatório de Investimentos – Dezembro/2020**

Data: 15/01/2021

RELATÓRIO N°. 001/2020 – COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **dezembro/2020**, 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 13)
- 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)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (páginas 18)
- 8) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado – FPREV (página 19)
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro – (páginas 20 a 21)
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 21)
- 11) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 22 a 28)
- 12) Total dos Recursos e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 28 e 29)
- 13) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 30)
- 14) Relatório de Riscos da Carteira (página 31 a 35)
- 15) Parecer do Comitê de Investimentos (página 36).
- 16) Parecer do Comitê de Investimentos (página 37).
- 17) Parecer do Comitê de Investimentos (página 38).



2

1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

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

Brasil: Copom reforça cenário de estímulos. PIB do 3º trimestre apresentou alta de 7,7%.

Mundo: China continua recuperação. Fed mantém estímulos. Com avanço da pandemia, BCE amplia estímulos.

O Comitê de Política Monetária (Copom) reafirma cenário em que: grau de estímulo elevado é mantido e esclarece condições que modificariam o compromisso de manter a taxa de juros no atual patamar. Em dois documentos divulgados no mês, o Banco Central avaliou a evolução da inflação e da atividade econômica no país e detalhou as projeções e perspectivas para os próximos trimestres. Em ata de reunião na qual a Selic foi mantida em 2,00% a.a., os membros enfatizaram que as condições para manter o compromisso de não elevar a taxa de juros (o “forward guidance”) podem, em breve, não ser mais satisfeitas. Dentre as condições, duas foram destacadas: 1) as expectativas e projeções para a inflação de 2021 e 2) a mudança no horizonte relevante de política monetária. O segundo documento divulgado, o Relatório Trimestral de Inflação, trouxe a abertura da projeção do Banco Central para a inflação, que foi revisada para cima e se situa pouco abaixo da meta para 2021 e próxima à meta para 2022.

Em linhas gerais, os dois documentos reforçam o cenário no qual uma elevação da taxa de juros não acontecerá nos primeiros meses do próximo ano. O movimento dependerá da evolução da atividade e da inflação no começo de 2021, quando os efeitos dos auxílios emergenciais se dissiparão e o nível de mobilidade se recuperará.

O PIB do 3º trimestre de 2020 registrou alta de 7,7% na margem, abaixo das expectativas. Em relação ao mesmo período do ano passado, houve recuo de 3,9%. Na comparação trimestral, pela ótica da demanda, houve crescimento do consumo das famílias (7,6%), do investimento (11,0%) e do consumo do governo (0,9%). Desempenho líquido do setor externo também foi positivo, apesar de queda nas exportações (-2,1%), as importações apresentaram recuo maior (-9,6%). Pela ótica da oferta, apenas a agropecuária apresentou queda (-0,5%). Os setores de serviços avançaram 6,3% e indústria, 14,8%. O resultado do 3º trimestre reflete a flexibilização das medidas de isolamento e retomada das atividades no país.

A atividade econômica avançou em outubro. O Índice do Banco Central de atividade (IBC-Br), indicador prévio do PIB, cresceu 0,9% na margem, refletindo as altas da indústria (1,1%), do comércio (2,1%) e do setor de serviços (1,7%) no mês. Na comparação interanual, o índice mantém queda de 2,6%. O indicador se situa 2,0% abaixo do patamar pré-pandemia. Para 2020, espera-se queda do PIB de 4,5%.

O IPCA de novembro e prévia de dezembro (IPCA-15), mantiveram cenário benigno para a inflação. A inflação de novembro variou 0,89% na margem, acumulando alta de 4,3% nos últimos 12 meses. Já a



Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

prévia da inflação ao consumidor (IPCA-15) de dezembro variou 1,06%, abaixo do esperado, com a média dos principais núcleos, que excluem ou suavizam itens voláteis, variando 0,39%. Em termos anuais, o IPCA-15 acumulado alta de 4,2%, mas os núcleos seguem abaixo da meta do Banco Central, crescendo 2,5% em doze meses. Isso sinaliza um cenário em que a inflação permanece comportada no próximo ano, em especial quando os choques que elevam a inflação corrente se dissiparem.

Nos EUA, o Fed manteve a taxa de juros entre 0% a.a e 0,25% a.a e apontou continuidade dos programas de estímulo (compra de ativos). Como sinalização, o Fed afirmou que manterá o patamar da taxa de juros e o programa de US\$120 bilhões mensais em compra de ativos, até avanço substancial em direção ao alcance das metas de pleno emprego e da estabilidade de preços. As expectativas do Fed para a economia apresentaram melhora na reunião de dezembro. A projeção de contração do PIB americano em 2020 passou de 3,7%, na reunião de setembro, para 2,4% agora. A projeção para o desemprego em 2020 também melhorou, passando de 7,6% para 6,7%. Diante de toda a incerteza oriunda do vírus e do impacto sobre o mercado de trabalho, avalia-se que os estímulos permanecerão por um período prolongado.

Com a ressurgência de casos de Covid-19, Banco Central Europeu (BCE) ampliou políticas de compra de ativos e refinanciamento. O BCE manteve o patamar da taxa de depósito em -0,5%, da taxa de refinanciamento em 0,0% e da taxa de empréstimo em 0,25%. A novidade veio com a ampliação e extensão das políticas de compra de títulos e refinanciamento que o banco já vinha implementando. O Programa Pandêmico de Compras Emergenciais (PEPP na sigla em inglês) foi expandindo em 500 bilhões de euros, chegando à 1,85 trilhões em compra de ativos, e o horizonte de compras foi estendido até março de 2022. O banco também anunciou a ampliação das políticas de refinanciamento de longo prazo (TLTRO III e PELTROS). Na entrevista após a reunião de dezembro, a presidente do BCE, Christine Lagarde, destacou que a segunda onda de COVID-19 e as novas medidas de restrição adotadas para conter a economia podem resultar em contração significativa na região. Por outro lado, a inflação se mantém baixa. Diante desse cenário, Lagarde deixou claro que o BCE segue determinado a manter o grau necessário de política monetária acomodatória.

Indicadores econômicos de novembro da China reforçam a rápida recuperação econômica do país. A produção industrial chinesa cresceu 7,0% em relação a novembro do ano passado, após alta de 6,9% em outubro. Já as vendas no varejo cresceram 5,0% na mesma métrica, uma aceleração frente ao avanço de 4,3% em outubro. Novembro foi o quarto mês consecutivo de alta do comércio, importante indicador da tendência de consumo no país asiático. A China deve manter trajetória de aceleração da retomada, crescendo cerca de 2,5% em 2020.

Perspectiva Renda Fixa – A crise de 2020 foi um desastre em escala global, que afetou todos os países simultaneamente. Os estímulos fiscais e monetários adotados durante a crise têm sido significativos, tanto



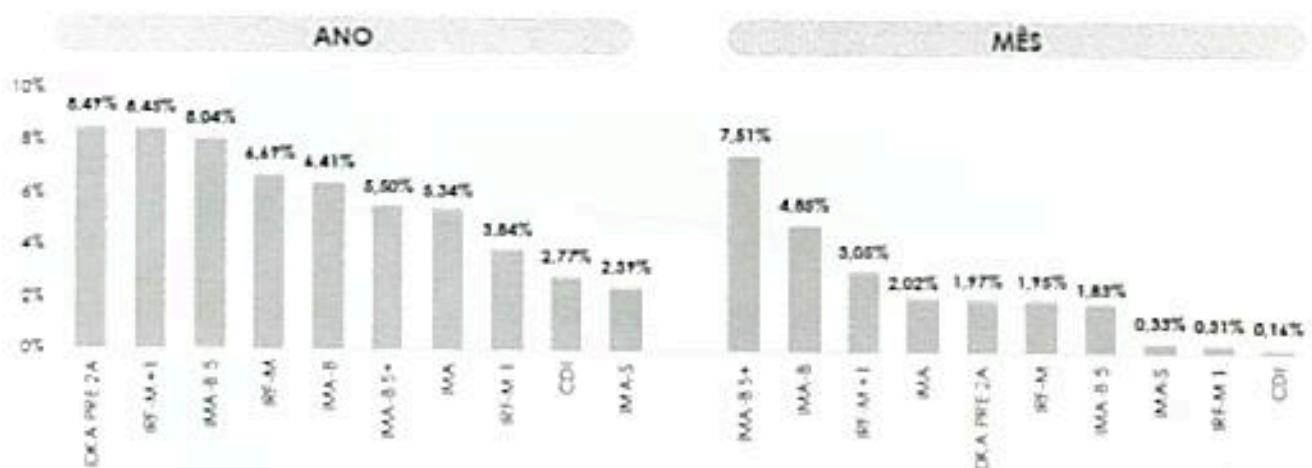
4

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

em magnitude quanto em utilização de instrumentos, com as transferências diretas de renda às famílias sendo o mais efetivo deles, contribuindo com uma rápida recuperação da atividade econômica global. A expectativa do mercado é de que os principais bancos centrais mantenham as suas políticas monetárias em um campo expansionista por um período prolongado. Isso deve continuar a sustentar a liquidez global. Por fim, os resultados dos testes das vacinas e o início da vacinação trouxeram alívio e otimismo para os mercados nos últimos meses. No cenário local, além dos benefícios trazidos pelos pontos mencionados anteriormente, o noticiário permaneceu mais tranquilo, principalmente do lado fiscal, o que reduziu o risco e contribuiu para a queda dos prêmios ao longo das curvas de juros. Com relação aos estímulos monetários que, por um lado, foram os responsáveis pela recuperação da atividade, apesar de toda a incerteza gerada no entorno do comprometimento fiscal por parte do governo, e por outro, trouxeram consigo uma série de choques inflacionários. Assim, o BC pode deixar de lado a comunicação que adotou este ano, logo após a taxa atingir o mínimo histórico, o motivo é o risco inflacionário.

Novamente, os ativos atrelados à inflação foram os destaques, além de se beneficiarem de uma queda das taxas devido à queda do risco fiscal, tiveram a inflação acima do esperado contribuindo positivamente. Os ativos prefixados também se beneficiaram da queda das taxas de juros em todos os vencimentos e foram o destaque da renda fixa no ano, nos vencimentos mais longos. Os ativos pós fixados, representados pelo IMA S da ANBIMA, se beneficiaram da redução do risco, terminando o mês com resultado de 200% do CDI, porém permanecem no ano com 86,59% do CDI. Por fim, o dólar cedeu 2,532% no mês, fechando dezembro a R\$ 5,1967. No ano, o resultado positivo foi de 28,928%.

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA FIXA



Perspectivas Renda Variável – Dezembro foi mais um mês excelente para as bolsas de valores em geral. A composição do governo dos EUA (mais ao centro), a expectativa de novos estímulos e os avanços das

5

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

vacinas contra o Covid 19 continuaram a proporcionar ambiente favorável aos ativos de risco. O S&P 500 teve retorno de 3,71%, ampliando o resultado positivo no ano para 16,26 % (em moeda original). O índice Nasdaq teve retorno de 5,65% ampliando o impressionante retorno de 43,64% no ano (em moeda original). O Ibovespa finalmente atingiu a máxima histórica com retorno de 9,30% no mês, encerrando o ano com rentabilidade de 2,92%. A bolsa brasileira tem se destacado positivamente nos últimos meses, refletindo o fluxo expressivo do investidor estrangeiro, o que é justificável também pela sua defasagem quando comparada com as ações de outros países em desenvolvimento e com a grande participação de setores ligados a commodities. Os dados continuam indicando recuperação econômica local, por outro lado, o desafio fiscal e o risco de uma nova onda de Covid 19, agravado de demora na vacinação da população, seguem como os principais riscos. A gestão continua com visão positiva para renda variável no médio e longo prazos, onde pode se destacar fatores como a expectativa de retomada da agenda de reformas do governo, retomada do crescimento do PIB e juros em patamares historicamente baixos, trazendo fluxo do investidor local para a bolsa. Sobre a performance dos diferentes setores, a dinâmica de forte recuperação dos que mais se desvalorizaram neste ano, como Bancos e empresas ligadas a commodities, continuou ao menos parcialmente em dezembro. O inverso ocorreu nos setores de Varejo e Bens de Capital.

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA VARIÁVEL

| | DEZEMBRO | 2020 | 12 MESES | 24 MESES | 36 MESES |
|------------------|----------|--------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA | 9,30% | 2,92% | 2,92% | 35,42% | 55,78% |
| SMLL | 7,52% | -0,65% | -0,65% | 57,16% | 69,94% |
| IBRX 100 | 9,15% | 3,50% | 3,50% | 38,06% | 59,35% |
| IDIV | 8,94% | -1,00% | -1,00% | 43,71% | 66,63% |
| S&P 500 (USD) | 3,71% | 16,26% | 16,26% | 49,83% | 40,49% |
| MSCI WORLD (USD) | 4,14% | 14,06% | 14,06% | 42,79% | 27,89% |



Relatório de Investimentos – Dezembro/2020


2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

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

| FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|--|-----------------------------|-----------------------------|-----------------|----------|----------|-----------|-----------|------------------|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 | out20 | nov20 | dez20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA | R\$ 371.157.985,89 | R\$ 379.987.948,55 | (0,0702) | 0,8479 | 2,3790 | 3,1746% | 5,0890% | 5,0890% |
| BB PREVID TP VII | R\$ 6.973.809,22 | R\$ 7.057.946,27 | 0,4925 | 1,1687 | 1,2064 | 2,8935% | 5,6114% | 5,6114% |
| BB PREVID IDKA 2 | R\$ 174.318.854,51 | R\$ 176.978.311,48 | - | 1,3400 | 1,5256 | 2,8860% | 2,8860% | 2,8860% |
| BB PREVID RF IMA B5+ | R\$ - | R\$ - | 0,2048 | 2,4941 | - | -0,0141% | -2,2459% | NC |
| BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA | R\$ 22.942.174,73 | R\$ - | (0,2800) | 0,7800 | - | 0,4978% | 2,1230% | 2,1230% |
| BRADESCO MANI PODER PUBLICO | R\$ 501.663,52 | R\$ 2.002.164,94 | 0,0400 | 0,1200 | 0,1800 | 0,3403% | 2,1479% | 2,1479% |
| CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF | R\$ 53.380.452,03 | R\$ 54.731.103,21 | (0,1900) | 1,5500 | 2,5300 | 3,9214% | 6,2951% | 6,2951% |
| CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP | R\$ 388.404.992,21 | R\$ 524.472.731,59 | 0,1812 | 1,2878 | 1,8198 | 3,3179% | 7,7470% | 7,7470% |
| CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA | R\$ 521.738.418,36 | R\$ 528.628.824,97 | (0,1078) | 0,8200 | 1,3207 | 2,0414% | 6,6644% | 6,6644% |
| ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO | R\$ 27.164.971,37 | R\$ 27.808.969,52 | 0,1100 | 1,3700 | 2,3700 | 3,8866% | 7,5957% | 7,5957% |
| ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF | R\$ 77.447.237,65 | R\$ 78.849.311,66 | 0,1500 | 1,3000 | 1,8100 | 3,2882% | 7,6461% | 7,6461% |
| ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF | R\$ 88.190.903,18 | R\$ 94.808.812,56 | 0,1900 | 2,5500 | 7,5000 | 10,4507% | 5,1122% | 5,1122% |
| ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI | R\$ 240.237.103,66 | R\$ 64.313.182,31 | 0,0800 | 0,1000 | 0,2000 | 0,3804% | 2,8573% | 2,8573% |
| SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF | R\$ 57.595.864,08 | R\$ 60.799.000,01 | (0,2570) | 2,1649 | 5,5614 | 7,5695% | 7,5982% | 7,5982% |
| TOTAL RENDA FIXA | R\$ 2.030.054.430,41 | R\$ 2.000.438.307,07 | | | | | | |
| FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 | out20 | nov20 | dez20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| BB MM GLOBAL SELECT | R\$ 43.570.386,34 | R\$ 44.046.955,17 | (1,8585) | 8,6135 | 1,0937 | 7,7607% | 7,7607% | NC |
| BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA | R\$ 94.870.602,82 | R\$ 105.039.692,39 | 2,2240 | 16,9752 | 10,7189 | 32,3940% | 5,9800% | 5,9800% |
| BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I | R\$ 69.920.316,21 | R\$ 70.397.488,98 | (1,7371) | 2,1010 | 0,6824 | 1,0120% | 18,2100% | NC |
| BRADESCO FIA MID SMALL CAPS | R\$ 118.124.682,45 | R\$ 128.292.874,16 | (2,4640) | 8,4500 | 8,6100 | 14,8852% | -1,8993% | NC |
| BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA | R\$ 31.716.107,87 | R\$ 34.706.335,56 | (0,2117) | 13,6600 | 9,4300 | 24,1149% | 4,6302% | 4,6302% |
| BTG ABSOLUTO FIQ FIA | R\$ 298.456.910,39 | R\$ 314.079.521,52 | (1,7304) | 8,6796 | 5,2345 | 12,3894% | 13,4580% | 13,4580% |
| BTG ECONOMIA REAL FIP | R\$ 5.610.091,01 | R\$ 5.569.463,88 | (0,4100) | (0,6644) | (0,7242) | -1,7881% | -1,7881% | NC |
| CAIXA CONSUMO FI AÇÕES | R\$ 90.782.425,07 | R\$ 95.218.278,37 | (2,9795) | 8,6332 | 4,8862 | 10,5466% | -0,5688% | -0,5688% |
| ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FI | R\$ 25.409.197,65 | R\$ 27.767.520,90 | (0,6500) | 14,8600 | 9,2800 | 24,7031% | 4,0286% | NC |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA | R\$ 226.889.947,32 | R\$ 244.961.155,29 | (2,0200) | 13,5800 | 7,9600 | 20,1440% | -9,4445% | -9,4445% |
| ITAÚ AÇÕES DYNAMES FIC | R\$ 162.071.129,66 | R\$ 172.274.057,48 | 0,5000 | 12,2800 | 6,3000 | 19,9504% | -2,4450% | -2,4450% |
| ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA | R\$ 9.842.133,19 | R\$ 10.665.485,89 | (1,3300) | 13,7500 | 8,3700 | 21,6314% | 2,1464% | 2,1464% |
| ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI | R\$ 118.268.366,68 | R\$ 127.693.596,92 | (4,1700) | 13,9200 | 7,9700 | 17,8700% | -21,2167% | -21,2167% |
| ITAÚ SMALL CAPS VALUATION | R\$ 51.208.939,43 | R\$ 55.061.046,42 | (1,4200) | 14,9700 | 7,5200 | 21,8604% | -8,2311% | NC |
| SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES | R\$ 67.416.021,48 | R\$ 72.548.595,13 | (1,9466) | 12,6315 | 7,6133 | 18,8470% | -6,0818% | -6,0818% |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES | R\$ 96.985.492,90 | R\$ 104.192.666,47 | (1,7365) | 13,4405 | 7,4312 | 19,7542% | -5,1498% | -5,1498% |
| SANTANDER SELEÇÃO 30 | R\$ 45.367.831,73 | R\$ 48.825.960,46 | (1,9452) | 12,6529 | 7,6224 | 18,8813% | -7,8320% | NC |
| SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC | R\$ 60.985.894,73 | R\$ 61.275.973,24 | (0,6111) | 4,3578 | 0,4756 | 4,2134% | 20,4635% | NC |
| SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO | R\$ 21.018.315,97 | R\$ 21.663.161,65 | (2,2950) | 10,5849 | 3,0680 | 11,3619% | 12,5705% | 12,5705% |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR | R\$ 94.760.875,79 | R\$ 95.089.603,00 | (1,4289) | 2,4433 | 0,3469 | 1,3298% | 19,0900% | NC |
| AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA | R\$ 79.225.665,18 | R\$ 84.713.090,08 | (2,0100) | 11,6500 | 6,9300 | 16,9877% | 31,7077% | NC |
| OCCAM FIC FIA | R\$ 94.470.410,26 | R\$ 104.020.515,68 | (0,3100) | 11,8900 | 10,1100 | 22,8202% | 35,5673% | NC |
| SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES | R\$ 31.252.849,09 | R\$ 33.658.143,72 | (3,5900) | 12,9328 | 7,6962 | 17,2582% | 26,3797% | NC |
| TOTAL RENDA VARIÁVEL | R\$ 1.938.224.593,22 | R\$ 2.061.761.182,36 | | | | | | |
| TOTAL GERAL | R\$ 3.968.279.023,63 | R\$ 4.062.199.489,43 | | | | | | |

Quadro 1.

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






Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

Nota 2: Com base na Ata COMIV 169/2020, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV, direcionando os novos recursos para o fundo CAIXA FI BRASIL IMA B5;

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

Nota 4: Os recursos do fundo Bradesco alocação Dinâmica foram utilizados para o pagamento da folha mensal de aposentados do FPREV Executivo.

2.2 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXECUTIVO

| INSTITUIÇÃO | out/20 | nov/20 | dez/20 |
|-----------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BRADERSCO | R\$ 165.585.093,24 | R\$ 173.284.628,57 | R\$ 165.001.374,66 |
| BANCO DO BRASIL | R\$ 836.565.720,74 | R\$ 760.811.954,99 | R\$ 783.508.342,84 |
| CAIXA | R\$ 992.115.713,69 | R\$ 1.054.306.287,67 | R\$ 1.203.050.938,14 |
| ITAÚ | R\$ 541.345.927,47 | R\$ 581.627.672,62 | R\$ 430.007.369,02 |
| SANTANDER | R\$ 244.047.894,12 | R\$ 270.755.240,84 | R\$ 286.843.195,30 |
| ICATU | R\$ 411.154.773,56 | R\$ 445.102.257,17 | R\$ 474.195.769,93 |
| SAFRA | R\$ 167.882.731,07 | R\$ 173.375.055,84 | R\$ 177.551.764,66 |
| BTG PACTUAL | R\$ 280.268.440,80 | R\$ 304.067.001,40 | R\$ 319.648.985,40 |
| AZ QUEST | R\$ 70.960.848,18 | R\$ 79.225.665,18 | R\$ 84.713.090,08 |
| OCCAM BRASIL | R\$ 84.434.250,92 | R\$ 94.470.410,26 | R\$ 104.020.515,68 |
| SULAMÉRICA | R\$ 27.673.836,27 | R\$ 31.252.849,09 | R\$ 33.658.143,72 |
| TOTAL | R\$ 3.822.035.230,06 | R\$ 3.968.279.023,63 | R\$ 4.062.199.489,43 |

Quadro 2.

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXEC
DEZEMBRO - 2020

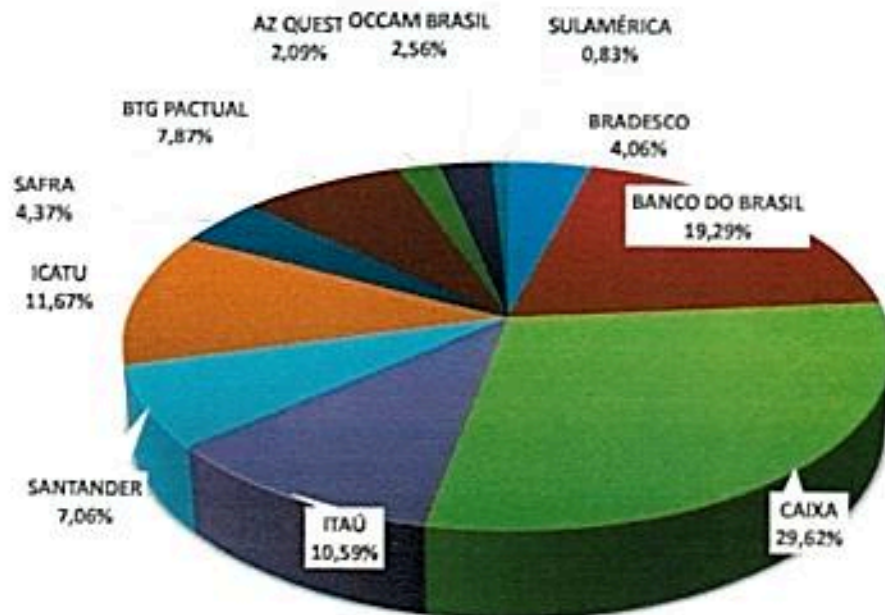


Gráfico 1

(Assinatura)

(Assinaturas)

2.3 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA – FPREV EXECUTIVO

| FUNDO DE INVESTIMENTO | ÍNDICE DE REFERÊNCIA | SALDO APLICADO | % APLICADO |
|---|----------------------|-----------------------------|-------------|
| BRDESCO FI MANI PODER PUBLICO | CDI | R\$ 2.002.164,94 | 0,05% |
| CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA BB PREVID ALOCAÇÃO ATIVA SAFRA S&P REALS BRDESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI | CDI ATIVO | R\$ 994.593.117,48 | 24,48% |
| BB PREVID IDKA 2 | IDKA 2 | R\$ 176.978.311,48 | 4,36% |
| ICATU VANG. FI RF INFLA. CP ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF | IMA B 5 | R\$ 631.131.012,77 | 15,54% |
| CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF BTG ECONOMIA REAL FIP BB PREVID TP VII | IMA B5+ | R\$ 94.808.812,56 | 2,33% |
| BRDESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA ICATU VANGUARDA AÇÕES IBRX FI | IBR X | R\$ 62.473.856,46 | 1,54% |
| BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA BRDESCO FIA MID SMALL CAPS ITAÚ SMALL CAPS VALUATION CAIXA CONSUMO FI AÇÕES ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES BTG ABSOLUTO FIQ FIA SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES SANTANDER SELEÇÃO 30 AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA OCCAM FIC FIA SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES | IBOVESPA | R\$ 1.701.244.679,98 | 41,88% |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR BB FIA BDR NIVEL I | BDR | R\$ 165.487.091,98 | 4,07% |
| SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC BB MM GLOBAL SELECT | MSCI | R\$ 105.322.928,41 | 2,59% |
| TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO | | R\$ 4.062.199.489,43 | 100% |

Quadro 3.

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

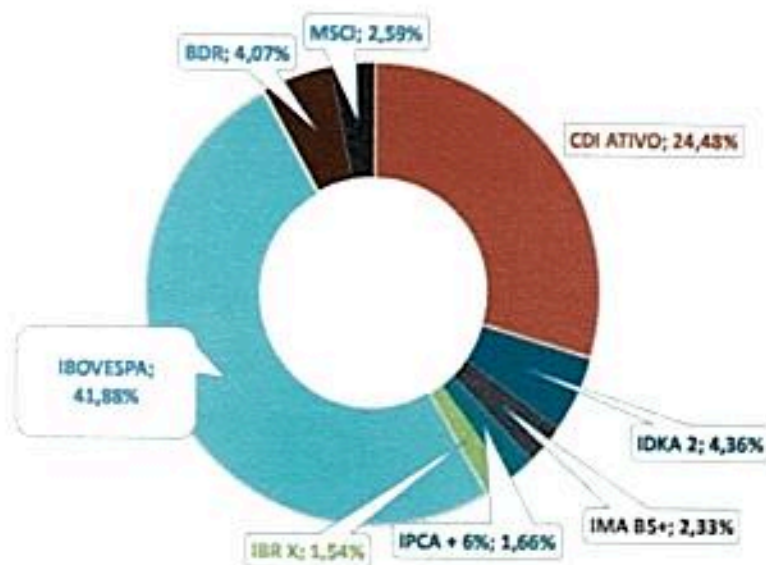


Gráfico 2.

(Assinaturas manuscritas)

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

| TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO) | SALDO | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|---|---------------------------|---------------------------|-----------------|--------|--------|-----------|----------|------------------|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 | out/20 | nov/20 | dez/20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| NTN-B (15/01/14 - 15/05/23) | R\$ 157.806.300,66 | R\$ 160.775.707,36 | 1,3891 | 1,4193 | 1,8817 | 4,763% | 11,2901% | 11,2901% |
| NTN-B (15/01/14 - 15/08/30) | R\$ 164.399.373,61 | R\$ 167.508.536,39 | 1,3986 | 1,4288 | 1,8912 | 4,792% | 11,4153% | 11,4153% |
| NTN-B (29/01/14 - 15/08/30) | R\$ 168.326.589,02 | R\$ 171.550.222,13 | 1,4223 | 1,4525 | 1,9151 | 4,866% | 11,7290% | 11,7290% |
| NTN-B (15/01/14 - 15/08/40) | R\$ 170.451.846,90 | R\$ 173.675.502,75 | 1,3986 | 1,4288 | 1,8912 | 4,792% | 11,4155% | 11,4155% |
| TOTAL GERAL | R\$ 660.984.110,18 | R\$ 673.509.968,62 | | | | | | |

Quadro 4.

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

2.6 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

| SEGMENTO | Renda Fixa | Renda Fixa | Renda Fixa | Renda Fixa |
|--------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| TIPO DE ATIVO | NTN B | NTN B | NTN B | NTN B |
| INTERMEDIÁRIO | 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\$ 160.775.707,36 | R\$ 167.508.536,39 | R\$ 171.550.222,13 | R\$ 173.675.502,75 |
| DATA DE EMISSÃO | 15/01/2014 | 10/02/2010 | 10/02/2010 | 10/02/2010 |
| DATA DA APLICAÇÃO | 15/01/2014 | 15/01/2014 | 29/01/2014 | 15/01/2014 |
| DATA DO RESGATE | 15/05/2023 | 15/08/2030 | 15/08/2030 | 15/08/2040 |
| TAXA DE JUROS CONTRATADA | 6,48% | 6,5998% | 6,90% | 6,60% |

Quadro 5.

2.7 SALDOS CVS – FPREV

| DESCRIÇÃO | SALDO | |
|--------------|--------------------------|--------------------------|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 |
| CVS - A | R\$ 1.274.906,10 | R\$ 1.257.452,78 |
| CVS - B | R\$ 8.248.980,30 | R\$ 8.136.002,50 |
| CVS - C | R\$ 165.383,40 | R\$ 163.119,32 |
| CVS - D | R\$ 904.610,52 | R\$ 892.221,00 |
| TOTAL | R\$ 10.593.880,32 | R\$ 10.448.795,60 |

Quadro 6.

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

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

2.8 CVS – REPASSE FINANCEIRO

| MÊS | JUROS | PRINCIPAL | TOTAL |
|--------------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
| jan/20 | R\$ 35.286,77 | R\$ 145.084,72 | R\$ 180.371,49 |
| fev/20 | R\$ 34.866,79 | R\$ 145.084,72 | R\$ 179.951,51 |
| mar/20 | R\$ 34.446,81 | R\$ 145.084,72 | R\$ 179.531,53 |
| abr/20 | R\$ 34.026,85 | R\$ 145.084,72 | R\$ 179.111,57 |
| mai/20 | R\$ 33.606,86 | R\$ 145.084,72 | R\$ 178.691,58 |
| jun/20 | R\$ 33.186,90 | R\$ 145.084,72 | R\$ 178.271,62 |
| jul/20 | R\$ 32.766,93 | R\$ 145.084,72 | R\$ 177.851,65 |
| ago/20 | R\$ 32.346,95 | R\$ 145.084,72 | R\$ 177.431,67 |
| set/20 | R\$ 31.926,99 | R\$ 145.084,72 | R\$ 177.011,71 |
| out/20 | R\$ 31.507,01 | R\$ 145.084,72 | R\$ 176.591,73 |
| nov/20 | R\$ 31.087,04 | R\$ 145.084,72 | R\$ 176.171,76 |
| dez/20 | R\$ 30.667,07 | R\$ 145.084,72 | R\$ 175.751,79 |
| TOTAL | R\$ 395.722,97 | R\$ 1.741.016,64 | R\$ 2.136.739,61 |

Quadro 7.

2.9 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

| RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2020 (Contrato Regular) | | | |
|---|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
| MÊS | UEA | SEAS | TOTAL |
| jan/20 | R\$ - | R\$ - | R\$ - |
| fev/20 | R\$ - | R\$ - | R\$ - |
| mar/20 | R\$ 58.180,96 | R\$ 301.093,20 | R\$ 359.274,16 |
| abr/20 | R\$ 58.180,96 | R\$ - | R\$ 58.180,96 |
| mai/20 | R\$ - | R\$ 301.093,20 | R\$ 301.093,20 |
| jun/20 | R\$ 145.452,40 | R\$ - | R\$ 145.452,40 |
| jul/20 | R\$ 43.635,72 | R\$ 100.364,00 | R\$ 143.999,72 |
| ago/20 | R\$ 43.635,72 | R\$ 200.728,80 | R\$ 244.364,52 |
| set/20 | R\$ 43.635,72 | R\$ - | R\$ 43.635,72 |
| out/20 | R\$ 58.180,96 | R\$ 100.364,40 | R\$ 158.545,36 |
| nov/20 | R\$ - | R\$ 200.729,20 | R\$ 200.729,20 |
| dez/20 | R\$ 159.997,64 | R\$ 100.364,40 | R\$ 260.362,04 |
| TOTAL | R\$ 610.900,08 | R\$ 1.304.737,20 | R\$ 1.915.637,28 |

Quadro 8.

2.10 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

| RECURSOS FPREV EXECUTIVO | SALDO | | % dos Recursos |
|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 | |
| FUNDOS DE INVESTIMENTO | R\$ 3.968.279.023,63 | R\$ 4.062.199.489,43 | 84,6697% |
| TÍTULOS PÚBLICOS | R\$ 660.984.110,18 | R\$ 673.509.968,62 | 14,0382% |
| TÍTULOS CVS | R\$ 10.593.880,32 | R\$ 10.448.795,60 | 0,2178% |
| IMÓVEIS | R\$ 60.353.005,55 | R\$ 51.536.297,82 | 1,0742% |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | R\$ 433.265,68 | R\$ 6.430,28 | 0,0001% |
| TOTAL | R\$ 4.700.643.285,36 | R\$ 4.797.700.981,75 | 100,00% |

Quadro 9.

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

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

2.11 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS – FPREV EXECUTIVO

| Mês | Recursos FPREV Executivo | Evolução | | |
|--------|--------------------------|----------|---------|----------|
| | | Mensal | Annual | 12 Meses |
| dez/19 | RS 5.173.977.182,42 | 4,14% | 27,68% | 27,68% |
| jan/20 | RS 5.215.753.953,85 | 0,81% | 0,81% | 25,83% |
| fev/20 | RS 5.147.828.344,11 | -1,30% | -0,51% | 22,61% |
| mar/20 | RS 4.677.866.125,22 | -9,13% | -9,59% | 9,54% |
| abr/20 | RS 4.755.324.126,81 | 1,66% | -8,09% | 9,55% |
| mai/20 | RS 4.808.084.982,84 | 1,11% | -7,07% | 8,26% |
| jun/20 | RS 4.837.475.067,57 | 0,61% | -6,50% | 6,07% |
| jul/20 | RS 4.902.116.484,95 | 1,34% | -5,25% | 5,41% |
| ago/20 | RS 4.797.635.488,57 | -2,13% | -7,27% | 2,10% |
| set/20 | RS 4.651.365.387,53 | -3,05% | -10,10% | -3,39% |
| out/20 | RS 4.549.328.612,79 | -2,19% | -12,07% | -7,68% |
| nov/20 | RS 4.700.643.285,36 | 3,33% | -9,15% | -5,39% |
| dez/20 | RS 4.797.700.981,75 | 2,06% | -7,27% | -7,27% |

Quadro 10.

2.12 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas - AM - EXECUTIVO2020

13/01/2021 12:43:24

| Fundo Previdenciário | | Cálculo Posicionado em 31/12/2020 | |
|--|-----------------|---------------------------------------|-------------------------|
| Mês/Ano | Receitas RS | Despesas RS | Resultado RS |
| | | Saldo Financeiro em 31/12/2019 | 5.173.977.182,42 |
| 01/2020 | 31.251.496,04 | 2.054.191,64 | 29.197.304,40 |
| 02/2020 | 49.583.021,72 | 4.910.443,54 | 44.672.578,18 |
| 03/2020 | 44.294.358,68 | 12.998.534,20 | 31.295.824,48 |
| 04/2020 | 41.873.777,81 | 100.097.233,40 | -58.223.455,59 |
| 05/2020 | 40.614.112,23 | 116.393.805,63 | -75.779.693,40 |
| 06/2020 | 32.820.094,52 | 156.602.317,41 | -123.782.222,89 |
| 07/2020 | 33.058.400,54 | 124.266.927,34 | -91.208.526,80 |
| 08/2020 | 39.455.936,02 | 99.107.615,94 | -59.651.679,92 |
| 09/2020 | 39.934.090,22 | 109.739.936,23 | -69.805.846,01 |
| 10/2020 | 38.961.921,68 | 112.188.198,10 | -73.226.276,42 |
| 11/2020 | 39.697.646,11 | 116.368.518,74 | -76.670.872,63 |
| 12/2020 | 117.527.713,10 | 175.934.562,52 | -58.406.849,42 |
| | | Saldo Financeiro em 31/12/2020 | 4.797.700.981,75 |
| Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos | | | |
| Taxa de Juros Anual: | 5,8800% | Índice de Inflação: | IPCA |
| Item | Em 12 meses | No Ano | No Mês |
| IPCA | 4,5173% | 4,5173% | 1,3500% |
| Juros | 5,8800% | 5,8800% | 0,4773% |
| Meta | 10,6630% | 10,6630% | 1,8337% |
| Rentabilidade % | 4,0860% | 4,0860% | 3,3073% |
| Rentabilidade RS | 205.313.515,35 | 205.313.515,35 | 155.464.545,81 |
| Resultado % | -5,9433% | -5,9433% | +1,4471% |
| Resultado RS | -330.849.239,50 | -330.849.239,50 | +69.268.220,00 |

Quadro 11.

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

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




Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

2.13 ACOMPANHAMENTO DE SALDO DO FTEMP

| ACOMPANHAMENTO DO SALDO DO FUNDO TEMPORÁRIO - FTEMP | | | | | | |
|---|--------------------------|--------------------------------|--------------------------|---------------------------------|---------------------------|--|
| REFERÊNCIA | APOSENTADO | 1ª PARC.13ª SALÁRIO APOSENTADO | PENSIONISTA | 1ª PARC.13ª SALÁRIO PENSIONISTA | TOTAL | SALDO DISPONÍVEL DO FUNDO TEMPORÁRIO (FTEMP) |
| SALDO INICIAL FTEMP (*) | | | | | | R\$ 1.088.777.939,69 |
| ABRIL | R\$ 66.682.153,93 | - | R\$ 20.836.497,85 | - | R\$ 87.518.651,78 | R\$ 1.001.259.287,91 |
| MAIO | R\$ 69.474.585,75 | - | R\$ 23.937.393,92 | - | R\$ 93.411.979,67 | R\$ 907.847.308,24 |
| JUNHO | R\$ 79.927.863,30 | R\$ 32.729.732,84 | R\$ 23.706.524,79 | R\$ 13.105.929,44 | R\$ 149.470.050,37 | R\$ 758.377.257,87 |
| JULHO | R\$ 78.896.538,13 | - | R\$ 23.547.513,10 | - | R\$ 102.444.051,23 | R\$ 655.933.206,64 |
| AGOSTO | R\$ 74.224.569,83 | - | R\$ 24.139.168,43 | - | R\$ 98.363.738,26 | R\$ 557.569.468,38 |
| SETEMBRO | R\$ 74.267.885,85 | - | R\$ 24.257.910,92 | - | R\$ 98.525.796,77 | R\$ 459.043.671,61 |
| OUTUBRO | R\$ 76.164.446,64 | - | R\$ 24.936.928,36 | - | R\$ 101.101.375,00 | R\$ 357.942.296,61 |
| NOVEMBRO | R\$ 75.776.269,96 | - | R\$ 25.170.897,70 | - | R\$ 100.947.167,66 | R\$ 256.995.128,95 |
| DEZEMBRO | R\$ 73.203.615,51 | R\$ 45.076.534,62 | R\$ 25.329.272,04 | R\$ 10.486.907,93 | R\$ 154.096.330,10 | R\$ 102.898.798,85 |
| TOTAL ACUMULADO | | | | | R\$ 985.879.140,84 | |

(*) Valor apurado em estudo atuarial efetuado pela empresa ACTUARIAL, em atendimento ao disposto no § 2º do art. 2º da Lei Complementar nº 204 de 16 de abril de 2020

Quadro 12.

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

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO- FPREV ALE

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

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO | | | | | | |
|--------------------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------|--------|--------|---------|-----------|---------|------------------|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 | set20 | out20 | nov20 | dez20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATEGICA | R\$ 4.987.324,69 | R\$ 5.187.064,37 | (0,1078) | 0,8200 | 1,3207 | 2,0414% | 6,6644% | 6,6644% | |
| ITAU INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC | R\$ 86.966,82 | R\$ 87.142,63 | 0,0800 | 0,1000 | 0,2000 | 0,3804% | 2,8616% | 2,8616% | |
| ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP | R\$ 1.897.046,34 | R\$ 1.942.019,49 | 0,1100 | 1,3700 | 2,3700 | 3,8866% | 7,5957% | NC | |
| TOTAL RENDA FIXA | R\$ 6.971.337,85 | R\$ 7.216.226,49 | | | | | | | |

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO | | | | | | |
|--------------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------|---------|---------|----------|-----------|----------|------------------|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 | set20 | out20 | nov20 | dez20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA | R\$ 500.643,34 | R\$ 540.518,31 | (2,0200) | 13,5800 | 7,9600 | 20,1440% | -9,4445% | -9,4445% | |
| BTG ABSOLUTO FIQ FIA | R\$ 1.529.129,81 | R\$ 1.609.171,51 | (1,7304) | 8,6796 | 5,2345 | 12,3894% | 8,5851% | NC | |
| CAIXA FIA CONSUMO | R\$ 223.191,87 | R\$ 234.097,57 | (2,9793) | 8,6332 | 4,8862 | 10,5466% | -0,5688% | NC | |
| OCCAM FIC FIA | R\$ 1.946.297,90 | R\$ 2.143.051,03 | (0,3100) | 11,8900 | 10,1100 | 22,8202% | 46,8059% | NC | |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR | R\$ 1.132.425,14 | R\$ 1.136.353,34 | (1,4300) | 2,4400 | 0,3500 | 1,3285% | 17,9569% | NC | |
| TOTAL RENDA VARIÁVEL | R\$ 5.331.688,06 | R\$ 5.663.191,96 | | | | | | | |

| | | |
|--------------------|--------------------------|--------------------------|
| TOTAL GERAL | R\$ 12.303.025,91 | R\$ 12.879.418,45 |
|--------------------|--------------------------|--------------------------|

Quadro 13.

Nota: Os Novos Recursos foram direcionados para o fundo CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA.

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

| TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO) | SALDO | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | | |
|--|-------------------------|-------------------------|-----------------|----------|----------|----------|-----------|----------|------------------|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 | set20 | out20 | nov20 | dez20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| NTN-B(15/01/14 - 15/08/30) | R\$ 2.245.024,66 | R\$ 2.287.483,14 | 1,177434 | 1,398600 | 1,428769 | 1,891225 | 4,7924% | 11,4153% | 11,4153% |
| TOTAL GERAL | R\$ 2.245.024,66 | R\$ 2.287.483,14 | | | | | | | |

Quadro 14.

3.3 Total dos Recursos – ALE/FPREV

| RECURSOS ALE FPREV | SALDO | |
|----------------------------|--------------------------|--------------------------|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 |
| FUNDOS DE INVESTIMENTO | R\$ 12.303.025,91 | R\$ 12.879.418,45 |
| TÍTULOS PÚBLICOS | R\$ 2.245.024,66 | R\$ 2.287.483,14 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | R\$ - | R\$ - |
| TOTAL | R\$ 14.548.050,57 | R\$ 15.166.901,59 |

Quadro 15.

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

3.4 Evolução dos Recursos – ALE/FPREV

| Mês | Recursos ALE FPREV | Evolução | | |
|---------------|-------------------------|--------------|---------------|---------------|
| | | Mensal | Anual | 12 Meses |
| dez/19 | RS 12.391.075,09 | 1,98% | 28,40% | 28,40% |
| jan/20 | RS 12.693.470,60 | 2,44% | 2,44% | 26,47% |
| fev/20 | RS 12.745.197,26 | 0,41% | 2,86% | 24,93% |
| mar/20 | RS 12.694.389,88 | -0,40% | 2,45% | 22,39% |
| abr/20 | RS 12.933.067,87 | 1,88% | 4,37% | 15,66% |
| mai/20 | RS 13.078.781,12 | 1,13% | 5,55% | 19,91% |
| jun/20 | RS 13.459.597,92 | 2,91% | 8,62% | 20,10% |
| jul/20 | RS 13.732.461,93 | 2,03% | 10,83% | 20,74% |
| ago/20 | RS 13.805.725,52 | 0,53% | 11,42% | 20,51% |
| set/20 | RS 13.772.193,11 | -0,24% | 11,15% | 16,97% |
| out/20 | RS 13.874.434,26 | 0,74% | 11,97% | 15,45% |
| nov/20 | RS 14.548.050,57 | 4,86% | 17,41% | 19,73% |
| dez/20 | RS 15.166.901,59 | 4,25% | 22,40% | 22,40% |

Quadro 16.

3.5 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas - AM - ASSEMBLEIA/2020

12/01/2021 15:11:49

| Fundo Previdenciário | | Cálculo Posicionado em 31/12/2020 | |
|---|--------------|-----------------------------------|---------------------------------------|
| Mês/Ano | Receitas RS | Despesas RS | Resultado RS |
| | | | Saldo Financeiro em 31/12/2019 |
| | | | 12.391.075,09 |
| 01/2020 | 232.286,40 | 0,00 | 232.286,40 |
| 02/2020 | 116.166,02 | 0,00 | 116.166,02 |
| 03/2020 | 116.289,97 | 0,00 | 116.289,97 |
| 04/2020 | 119.283,88 | 0,00 | 119.283,88 |
| 05/2020 | 119.498,47 | 0,00 | 119.498,47 |
| 06/2020 | 118.639,37 | 0,00 | 118.639,37 |
| 07/2020 | 118.639,37 | 0,00 | 118.639,37 |
| 08/2020 | 154.104,87 | 0,00 | 154.104,87 |
| 09/2020 | 170.237,76 | 0,00 | 170.237,76 |
| 10/2020 | 143.453,76 | 0,00 | 143.453,76 |
| 11/2020 | 143.747,84 | 0,00 | 143.747,84 |
| 12/2020 | 133.342,71 | 0,00 | 133.342,71 |
| | | | Saldo Financeiro em 31/12/2020 |
| | | | 15.166.901,59 |
| Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos | | | |
| Taxa de Juros Anual: | 5,8800% | Índice de Inflação: | IPCA |
| Item | Em 12 meses | No Ano | No Mês |
| IPCA | 4,5173% | 4,5173% | 1,3500% |
| Juros | 5,8800% | 5,8800% | 0,4773% |
| Meta | 10,6630% | 10,6630% | 1,8337% |
| Rentabilidade % | 8,2804% | 8,2804% | 3,3373% |
| Rentabilidade RS | 1.090.136,08 | 1.090.136,08 | 485.508,31 |
| Resultado % | -2,1530% | -2,1530% | +1,4765% |
| Resultado RS | -313.356,50 | -313.356,50 | -218.738,76 |

Quadro 17.

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

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

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|-----------------------------|---------------------------|---------------------------|-----------------|--------|--------|-----------|---------|------------------|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 | out20 | nov20 | dez20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA | R\$ 6.011.932,62 | R\$ 7.687.666,70 | (0,1078) | 0,8200 | 1,3207 | 2,0414% | 0,9622% | NC |
| BRANDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA | R\$ 49.664.165,45 | R\$ 50.875.562,47 | (0,2800) | 0,7800 | 2,4800 | 2,9902% | 4,6556% | 4,6556% |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA | R\$ 96.951.318,02 | R\$ 99.257.819,70 | (0,0702) | 0,8479 | 2,3790 | 3,1746% | 4,9841% | 4,9841% |
| TOTAL RENDA FIXA | R\$ 152.627.416,09 | R\$ 157.821.048,87 | | | | | | |

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|--------------------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------|---------|--------|-----------|----------|------------------|
| | 30/11/2020 | 30/11/2020 | out20 | nov20 | dez20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| BRANDESCO FIC FIA INSTIT IIBRX ALPHA | R\$ 10.437.137,99 | R\$ 11.421.162,23 | - | 13,6600 | 9,4300 | 24,3781% | 24,3781% | NC |
| TOTAL RENDA VARIÁVEL | R\$ 10.437.137,99 | R\$ 11.421.162,23 | | | | | | |

| | | |
|--|---------------------------|---------------------------|
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ 3.002,10 | R\$ - |
| TOTAL RECURSOS | R\$ 163.067.556,18 | R\$ 169.242.211,10 |

Quadro 18.

Nota: Os Novos Recursos foram direcionados para o fundo CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA.

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - PGJMP2020

13/01/2021 12:39:57

| Fundo Previdenciário | | Cálculo Posicionado em 31/12/2020 | |
|---|---------------|-----------------------------------|---|
| Mês/Ano | Receitas R\$ | Despesas R\$ | Resultado R\$ |
| | | | Saldo Financeiro em 31/12/2019 142.456.938,05 |
| 01/2020 | 2.720.554,80 | 16.316,13 | 2.704.238,67 |
| 02/2020 | 1.490.511,62 | 15.618,19 | 1.474.893,43 |
| 03/2020 | 1.275.904,25 | 16.735,98 | 1.259.168,27 |
| 04/2020 | 1.268.670,97 | 10.639,28 | 1.258.031,69 |
| 05/2020 | 1.482.380,96 | 0,00 | 1.482.380,96 |
| 06/2020 | 1.273.507,14 | 10.584,16 | 1.262.922,98 |
| 07/2020 | 1.272.066,06 | 11.829,88 | 1.260.236,18 |
| 08/2020 | 1.482.857,02 | 9.164,74 | 1.473.692,28 |
| 09/2020 | 1.514.681,38 | 7.663,69 | 1.507.017,69 |
| 10/2020 | 1.490.094,20 | 9.164,74 | 1.480.929,46 |
| 11/2020 | 1.503.550,04 | 9.164,74 | 1.494.385,30 |
| 12/2020 | 1.579.792,66 | 12.799,56 | 1.566.993,10 |
| | | | Saldo Financeiro em 31/12/2020 169.242.211,10 |
| Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos | | | |
| Taxa de Juros Anual: | 5,8800% | Índice de Inflação: | IPCA |
| Item | Em 12 meses | No Ano | No Mês |
| IPCA | 4,5173% | 4,5173% | 1,3500% |
| Juros | 5,8800% | 5,8800% | 0,4773% |
| Meta | 10,6630% | 10,6630% | 1,8337% |
| Rentabilidade % | 5,6642% | 5,6642% | 2,8256% |
| Rentabilidade R\$ | 8.560.383,04 | 8.560.383,04 | 4.607.661,82 |
| Resultado % | -4,5171% | -4,5171% | +0,9740% |
| Resultado R\$ | -7.547.590,79 | -7.547.590,79 | +1.617.470,19 |

Quadro 19

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | | |
|--|--------------------------|--------------------------|-----------------|--------|--------|---------|-----------|---------|------------------|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 | set/20 | out/20 | nov/20 | dez/20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA | R\$ 3.833.114,15 | R\$ 6.861.925,55 | (0,1078) | 0,8200 | 1,3207 | 2,0414% | 0,9622% | NC | |
| BRDESCO INST. ALOC. DINAMICA | R\$ 8.445.660,78 | R\$ 8.655.092,79 | 0,1300 | 0,7800 | 2,4800 | 3,4136% | 6,6584% | 6,6584% | |
| BRDESCO INST. FIC FI RF IMA B5 | R\$ 9.712.269,72 | R\$ 9.810.995,35 | (0,2800) | 1,3000 | 1,7800 | 2,8145% | 5,8276% | 5,8276% | |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ 6.025,14 | R\$ - | | | | | | | |
| TOTAL | R\$ 21.997.069,79 | R\$ 25.328.013,69 | | | | | | | |

Quadro 20.

Nota: Os Novos Recursos foram direcionados para o fundo CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA.

5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Ciente: Govetto Amazonas / AM - DEFENSORIA2020

09.12.2020 10:10:53

Fundo Previdenciário

Cálculo Posicionado em 30/11/2020

| Mês/Ano | Receitas R\$ | Despesas R\$ | Resultado R\$ |
|---------|---------------------------------------|--------------|----------------------|
| 12/2019 | 2.476.831,17 | 0,00 | 2.476.831,17 |
| 01/2020 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 02/2020 | 814.914,53 | 0,00 | 814.914,53 |
| 03/2020 | 810.969,30 | 0,00 | 810.969,30 |
| 04/2020 | 818.197,74 | 0,00 | 818.197,74 |
| 05/2020 | 954.963,10 | 0,00 | 954.963,10 |
| 06/2020 | 808.818,93 | 0,00 | 808.818,93 |
| 07/2020 | 809.559,37 | 0,00 | 809.559,37 |
| 08/2020 | 951.659,78 | 0,00 | 951.659,78 |
| 09/2020 | 950.378,64 | 0,00 | 950.378,64 |
| 10/2020 | 952.657,42 | 0,00 | 952.657,42 |
| 11/2020 | 969.890,42 | 19.728,47 | 950.161,95 |
| | Saldo Financeiro em 30/11/2019 | | 9.856.121,02 |
| | Saldo Financeiro em 30/11/2020 | | 21.997.069,79 |

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

| Item | Em 12 meses | No Ano | No Mês |
|----------------------|-------------|-------------|------------|
| Taxa de Juros Anual: | 5,8800 % | | |
| Índice de Inflação: | | IPCA | |
| IPCA | 4,3111 % | 3,1252 % | 0,8900 % |
| Juros | 5,8800 % | 5,3771 % | 0,4773 % |
| Meta | 10,4446 % | 8,6703 % | 1,3715 % |
| Rentabilidade % | 5,5132 % | 4,5175 % | 1,0305 % |
| Rentabilidade R\$ | 841.836,84 | 718.379,89 | 214.680,43 |
| Resultado % | -4,4651 % | -3,8215 % | -0,3364 % |
| Resultado R\$ | -748.905,64 | -657.848,76 | -71.037,31 |

Quadro 21.

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | | |
|----------------------------------|---------------------------|---------------------------|-----------------|--------|--------|-----------|---------|------------------|--|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 | out20 | nov20 | dez20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES | |
| CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA | R\$ 195.157.016,00 | R\$ 204.221.045,98 | (0,1078) | 0,8200 | 1,3207 | 2,0414% | 0,9622% | NC | |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA | R\$ 50.599.668,72 | R\$ 51.803.450,40 | (0,0702) | 0,8479 | 2,3790 | 3,1746% | 3,2822% | NC | |
| BB PREV RF IDKA 2 | R\$ 138.091.209,36 | R\$ 140.197.967,29 | - | 1,3400 | 1,5256 | 2,8860% | 2,8860% | NC | |
| BRABESCO INST. FIC FI RF IMA B 3 | R\$ 42.738.748,66 | R\$ 43.418.042,67 | 0,1300 | 1,3000 | 2,4800 | 3,9472% | 8,5929% | 8,5929% | |
| BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RF | R\$ 1.419.431,15 | R\$ 1.454.629,62 | (0,2800) | 0,7800 | 1,7800 | 2,2867% | 3,4985% | NC | |
| TOTAL RENDA FIXA | R\$ 428.006.073,89 | R\$ 441.095.135,96 | | | | | | | |

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | | |
|-----------------------------|-------------------------|--------------------------|-----------------|--------|--------|-----------|----------|------------------|--|
| | 31/10/2020 | 31/12/2020 | out20 | nov20 | dez20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES | |
| CAIXA FIA CONSUMO | R\$ 9.950.014,00 | R\$ 10.436.196,24 | - | 8,6332 | 4,8860 | 13,9410% | 13,9410% | NC | |
| TOTAL RENDA VARIÁVEL | R\$ 9.950.014,00 | R\$ 10.436.196,24 | | | | | | | |

| | | |
|--|---------------------------|---------------------------|
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ 29.078,79 | R\$ - |
| TOTAL | R\$ 437.985.166,68 | R\$ 451.531.332,20 |

Quadro 22.

Nota: Os Novos Recursos foram direcionados para o fundo CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA.

6.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - TRIBUNAL JUSTICA 2020

12/01/2021 15:25:48

Fundo Previdenciário

Cálculo Posicionado em 31/12/2020

| Mês/Ano | Receitas R\$ | Despesas R\$ | Resultado R\$ |
|---------|----------------|--------------|---------------------------------------|
| | | | Saldo Financeiro em 31/12/2019 |
| | | | 22.151.234,44 |
| 01/2020 | 2.510.168,73 | 282.187,91 | 2.227.980,82 |
| 02/2020 | 2.546.041,07 | 248.112,69 | 2.297.928,38 |
| 03/2020 | 2.647.202,34 | 269.053,00 | 2.378.149,34 |
| 04/2020 | 3.365.431,19 | 341.730,86 | 3.023.700,33 |
| 05/2020 | 5.222.844,03 | 280.083,57 | 4.942.760,46 |
| 06/2020 | 2.652.044,89 | 345.842,60 | 2.306.202,29 |
| 07/2020 | 3.093.956,95 | 155.165,84 | 2.938.791,11 |
| 08/2020 | 3.115.630,27 | 491.741,78 | 2.623.888,49 |
| 09/2020 | 381.166.785,90 | 305.986,37 | 380.860.799,53 |
| 10/2020 | 3.325.215,77 | 305.986,37 | 3.019.229,40 |
| 11/2020 | 3.555.836,55 | 303.719,14 | 3.252.117,41 |
| 12/2020 | 6.779.546,58 | 408.928,65 | 6.370.617,93 |
| | | | Saldo Financeiro em 31/12/2020 |
| | | | 451.531.332,20 |

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

| Taxa de Juros Anual: | 5,8800% | Índice de Inflação: | IPCA |
|----------------------|---------------|---------------------|--------------|
| Item | Em 12 meses | No Ano | No Mês |
| IPCA | 4,5173% | 4,5173% | 1,3500% |
| Juros | 5,8800% | 5,8800% | 0,4773% |
| Meta | 10,6630% | 10,6630% | 1,8337% |
| Rentabilidade % | 10,2384% | 10,2384% | 1,6383% |
| Rentabilidade R\$ | 13.137.932,27 | 13.137.932,27 | 7.175.547,59 |
| Resultado % | -0,3837% | -0,3837% | -0,1919% |
| Resultado R\$ | -529.329,60 | -529.329,60 | -855.845,10 |

Quadro 23.

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | | |
|---------------------------------|--------------------------|---------------------------|-----------------|--------|--------|-----------|---------|------------------|--|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 | out20 | nov20 | dez20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES | |
| CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA | R\$ 41.001.352,53 | R\$ 42.064.656,38 | (0,1078) | 0,8200 | 1,3207 | 2,0414% | 0,9622% | NC | |
| BBI PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA | R\$ 50.599.668,72 | R\$ 51.803.450,40 | (0,0702) | 0,8479 | 2,3790 | 3,1746% | 3,2822% | NC | |
| BRDESCO INST. FIC FI RF IMA B 5 | R\$ 7.445.015,81 | R\$ 7.577.359,82 | 0,1300 | 1,3000 | 1,7800 | 3,2372% | 7,8511% | 7,8511% | |
| TOTAL RENDA FIXA | R\$ 99.046.037,06 | R\$ 101.445.466,60 | | | | | | | |

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | | |
|-----------------------|-------------------------|--------------------------|-----------------|--------|--------|-----------|----------|------------------|--|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 | out20 | nov20 | dez20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES | |
| CAIXA FIA CONSUMO | R\$ 9.950.014,00 | R\$ 10.436.196,24 | - | 8,6332 | 4,8862 | 13,9412% | 13,9412% | NC | |
| TOTAL | R\$ 9.950.014,00 | R\$ 10.436.196,24 | | | | | | | |

| | | |
|--|---------------------------|---------------------------|
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ - | R\$ - |
| TOTAL | R\$ 108.996.051,06 | R\$ 111.881.662,84 |

Quadro 24.

Nota: Os Novos Recursos foram direcionados para o fundo CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA.

7.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - TRIBUNAL CONTAS 2020

09/12/2020 10:21:29

Fundo Previdenciário

Cálculo Posicionado em 30/11/2020

| Mês/Ano | Receitas R\$ | Despesas R\$ | Resultado R\$ |
|---------|---------------|--------------|--|
| | | | Saldo Financeiro em 30/11/2019 3.260.451,82 |
| 12/2019 | 205.915,34 | 0,00 | 205.915,34 |
| 01/2020 | 696.572,08 | 0,00 | 696.572,08 |
| 02/2020 | 445.775,50 | 0,00 | 445.775,50 |
| 03/2020 | 245.127,45 | 0,00 | 245.127,45 |
| 04/2020 | 770.472,25 | 0,00 | 770.472,25 |
| 05/2020 | 446.927,24 | 0,00 | 446.927,24 |
| 06/2020 | 447.429,30 | 0,00 | 447.429,30 |
| 07/2020 | 522.267,78 | 0,00 | 522.267,78 |
| 08/2020 | 522.585,60 | 0,00 | 522.585,60 |
| 09/2020 | 99.120.333,45 | 0,00 | 99.120.333,45 |
| 10/2020 | 521.775,18 | 0,00 | 521.775,18 |
| 11/2020 | 1.032.124,86 | 0,00 | 1.032.124,86 |
| | | | Saldo Financeiro em 30/11/2020 108.996.051,06 |

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

| Taxa de Juros Anual: | 5,8800 % | Índice de Inflação: | IPCA |
|----------------------|---------------|---------------------|-------------|
| Item | Em 12 meses | No Ano | No Mês |
| IPCA | 4,3111 % | 3,1252 % | 0,8900 % |
| Juros | 5,8800 % | 5,3771 % | 0,4773 % |
| Meta | 10,4446 % | 8,6703 % | 1,3715 % |
| Rentabilidade % | 3,4456 % | 3,0184 % | 0,6757 % |
| Rentabilidade R\$ | 758.293,21 | 718.106,58 | 724.664,50 |
| Resultado % | -6,3371 % | -5,2009 % | -0,6864 % |
| Resultado R\$ | -1.490.793,36 | -1.308.956,89 | -746.141,23 |

Quadro 25.

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - CALCULOATUARIAL2020

13/01/2021 12:45:50

| Fundo Previdenciário | | Cálculo Posicionado em 31/12/2020 | |
|--|---------------------|--|-------------------------|
| | | Saldo Financeiro em 31/12/2019 | 5.366.939.392,93 |
| Mês/Ano | Receitas R\$ | Despesas R\$ | Resultado R\$ |
| 01/2020 | 37.411.078,15 | 2.352.695,68 | 35.058.382,47 |
| 02/2020 | 54.996.430,46 | 5.174.174,42 | 49.822.256,04 |
| 03/2020 | 49.389.851,69 | 13.284.323,18 | 36.105.528,51 |
| 04/2020 | 48.215.833,84 | 100.449.603,54 | -52.233.769,70 |
| 05/2020 | 48.840.726,03 | 116.673.889,20 | -67.833.163,17 |
| 06/2020 | 38.120.534,15 | 153.958.744,17 | -115.838.210,02 |
| 07/2020 | 38.874.890,07 | 124.433.923,06 | -85.559.032,99 |
| 08/2020 | 45.682.773,56 | 99.608.522,46 | -53.925.748,90 |
| 09/2020 | 522.856.507,35 | 110.053.586,29 | 412.802.921,06 |
| 10/2020 | 45.495.482,41 | 112.503.349,21 | -67.007.866,80 |
| 11/2020 | 46.902.795,82 | 116.701.131,09 | -69.798.335,27 |
| 12/2020 | 129.523.150,14 | 176.448.361,04 | -46.925.210,90 |
| | | Saldo Financeiro em 31/12/2020 | 5.570.851.103,17 |
| Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos | | | |
| Taxa de Juros Anual: | 5,8800 % | Índice de Inflação: | IPCA |
| Item | Em 12 meses | No Ano | No Mês |
| IPCA | 4,5173 % | 4,5173 % | 1,3500 % |
| Juros | 5,8800 % | 5,8800 % | 0,4773 % |
| Meta | 10,6630 % | 10,6630 % | 1,8337 % |
| Rentabilidade % | 4,2704 % | 4,2704 % | 3,1307 % |
| Rentabilidade R\$ | 229.243.959,91 | 229.243.959,91 | 170.539.134,43 |
| Resultado % | -5,7766 % | -5,7766 % | +1,2737 % |
| Resultado R\$ | -343.198.267,21 | -343.198.267,21 | +70.652.416,34 |

Quadro 26.

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

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

9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

| DESCRIÇÃO | SALDOS | |
|---|-------------------------|--------------------------|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 |
| FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 1.555.452,07 | R\$ 56.320.916,20 |
| FUNDO BRADESCO FIC FI RF ALOC. DINÂMICA - COMPREV | R\$ 5.126.783,44 | R\$ 5.325.299,78 |
| REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO | R\$ 0,02 | R\$ 0,02 |
| COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO | R\$ 34.841,70 | R\$ 34.817,75 |
| SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS | R\$ 148.299,19 | R\$ 213.938,35 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | R\$ 1,00 | R\$ 9.966,16 |
| TOTAL | R\$ 6.865.377,42 | R\$ 61.904.938,26 |

Quadro 27.

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

9.2 Fundo Previdenciário Militares

| DESCRIÇÃO | SALDOS | |
|--|--------------------------|--------------------------|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM | R\$ 1.799,35 | R\$ 5.120.613,59 |
| BRADESCO DI PREMIUM - FPPM | R\$ - | R\$ 8.914.604,45 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM | R\$ 6.703,84 | R\$ - |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FTEMP | R\$ - | R\$ - |
| BRADESCO DI PREMIUM - FTEMP | R\$ 409.179,84 | R\$ 410.063,48 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP | R\$ 13.389.643,45 | R\$ 504.124,99 |
| TOTAL | R\$ 13.807.326,48 | R\$ 14.949.406,51 |

Quadro 28.

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

9.3 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

| DESCRIÇÃO | SALDOS | |
|--|-------------------|-----------------------|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ - | R\$ 313.673,83 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ 369,81 | R\$ - |
| TOTAL | R\$ 369,81 | R\$ 313.673,83 |

Quadro 29.

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | |
|--|-----------------------|-----------------------|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 396.004,26 | R\$ 234.524,35 |
| DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN | R\$ 42.257,24 | R\$ 2.075,42 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ - | R\$ 1,00 |
| TOTAL | R\$ 438.261,50 | R\$ 236.600,77 |

Quadro 30.

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | |
|--|-----------------------|-------------------------|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 627.524,18 | R\$ 1.141.738,91 |
| DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN | R\$ 198.120,93 | R\$ - |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ - | R\$ 565.981,40 |
| TOTAL | R\$ 825.645,11 | R\$ 1.707.720,31 |

Quadro 31.

9.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | |
|--|-------------------------|--------------------------|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 6.276.740,51 | R\$ 10.450.301,46 |
| DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN | R\$ 530.499,98 | R\$ - |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ - | R\$ - |
| TOTAL | R\$ 6.807.240,49 | R\$ 10.450.301,46 |

Quadro 32.

9.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | |
|--|--------------------------|-------------------------|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 13.195.315,77 | R\$ 7.545.184,36 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ - | R\$ 1,00 |
| TOTAL | R\$ 13.195.315,77 | R\$ 7.545.185,36 |

Quadro 33.

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|--|--------------------------|--------------------------|-----------------|--------|--------|-----------|---------|------------------|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 | out20 | nov20 | dez20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| BRASESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 1.575.883,01 | R\$ 1.930.353,60 | 0,0400 | 0,1200 | 0,1800 | 0,3403% | 2,1455% | 2,1455% |
| CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA | R\$ 40.496.120,74 | R\$ 37.008.399,35 | (0,1078) | 0,8200 | 1,3207 | 2,0414% | 6,6644% | 6,6644% |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ 1,00 | R\$ 1,00 | | | | | | |
| TOTAL | R\$ 41.774.638,52 | R\$ 38.938.753,95 | | | | | | |

Quadro 34.

10.2 Taxa de Administração - ALE

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|--|-------------------------|-------------------------|-----------------|--------|--------|-----------|---------|------------------|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 | out20 | nov20 | dez20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| BRASESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 1.265.312,65 | R\$ 1.302.358,29 | 0,0400 | 0,1200 | 0,1800 | 0,3403% | 2,1455% | 2,1455% |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ - | R\$ - | | | | | | |
| TOTAL | R\$ 1.265.312,65 | R\$ 1.302.358,29 | | | | | | |

Quadro 35.

10.3 Taxa de Administração - TCE

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|--|-----------------------|-----------------------|-----------------|--------|--------|-----------|---------|------------------|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 | out20 | nov20 | dez20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| BRASESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 853.757,20 | R\$ 855.317,71 | 0,0400 | 0,1200 | 0,1800 | 0,3403% | 2,1455% | 2,1455% |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ - | R\$ - | | | | | | |
| TOTAL | R\$ 853.757,20 | R\$ 855.317,71 | | | | | | |

Quadro 36.

10.4 Taxa de Administração – TJ/AM

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|--|-------------------------|-------------------------|-----------------|--------|--------|-----------|---------|------------------|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 | out20 | nov20 | dez20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| BRASESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 2.422.836,66 | R\$ 1.875.237,11 | 0,0400 | 0,1200 | 0,1800 | 0,3403% | 2,1455% | 2,1455% |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ - | R\$ - | | | | | | |
| TOTAL | R\$ 2.422.836,66 | R\$ 1.875.237,11 | | | | | | |

Quadro 37.

Nota: Transferido o valor de R\$ 1.000.000,00 (um milhão de reais) para a conta operacional dos recursos da Taxa de Administração (20.400-5 Bradesco) em 22/12/20, para pagamento das despesas administrativas dessa Amazonprev.

10.5 Taxa de Administração – PGJ/MPE

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|--|-----------------------|-----------------------|-----------------|--------|--------|-----------|---------|------------------|
| | 30/11/2020 | 31/12/2020 | out20 | nov20 | dez20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| BRASESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 754.759,98 | R\$ 756.139,54 | 0,0400 | 0,1200 | 0,1800 | 0,3403% | 0,3703% | 0,3703% |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ - | R\$ - | | | | | | |
| TOTAL | R\$ 754.759,98 | R\$ 756.139,54 | | | | | | |

Quadro 38.

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

11. ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS

11.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

| SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA | TOTAL | % DA CARTEIRA | ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020 | | Resolução CMN nº 3.922/2010 |
|--|-----------------------------|---------------|-----------------------------------|-----------------|-----------------------------|
| | | | LIMITE ALVO | LIMITE SUPERIOR | |
| TÍTULOS DO TN | R\$ 675.797.451,76 | 11,96% | 10% | 100% | art. 7º, inciso I, "a" |
| TOTAL art. 7º, inciso I, "a" | R\$ 675.797.451,76 | | | | |
| BB PREVIDENCIÁRIO TP VII | R\$ 7.057.946,27 | 34,87% | 10% | 100% | art. 7º, inciso I, "b" |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 | R\$ 317.176.278,77 | | | | |
| CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP | R\$ 524.472.731,59 | | | | |
| CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF | R\$ 54.731.103,21 | | | | |
| CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA | R\$ 831.659.583,30 | | | | |
| ICATU VANG INFLAÇÃO CURTA FI RF | R\$ 78.849.311,66 | | | | |
| ICATU VANG INFLAÇÃO LONGA FI RF | R\$ 94.808.812,56 | | | | |
| SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF | R\$ 60.799.000,01 | | | | |
| TOTAL art. 7º, inciso I, "b" | R\$ 1.969.554.767,37 | | | | |
| BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 89.848.523,89 | 15,47% | 30% | 40% | art. 7º, inciso IV, "a" |
| BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5 | R\$ 60.806.397,84 | | | | |
| BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA | R\$ 66.310.584,66 | | | | |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA | R\$ 582.852.669,05 | | | | |
| ITAU INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC | R\$ 64.400.324,94 | | | | |
| BRDESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM | R\$ 9.324.667,93 | | | | |
| TOTAL art. 7º, inciso IV, "a" | R\$ 873.543.168,31 | | | | |
| ICATU VANG FI RF INFLAÇÃO CP LP | R\$ 29.750.989,01 | 0,53% | 5% | 5% | art. 7º, inciso VII, "b" |
| TOTAL art. 7º, inciso VII, "b" | R\$ 29.750.989,01 | | | | |
| TOTAL RENDA FIXA | R\$ 3.548.646.376,45 | 62,83% | | | |

Quadro 39.

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

11.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Variável

| SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL | TOTAL | % DA CARTEIRA | ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020 | | Resolução CMN nº 3.922/2010 |
|--|-----------------------------|---------------|-----------------------------------|-----------------|-----------------------------|
| | | | LIMITE ALVO | LIMITE SUPERIOR | |
| BRABESCO INST IRR X ALPHA | R\$ 46.127.497,29 | 1,31% | 10% | 30% | art. 8º, inciso I, "a" |
| ICATU VANGUARDA AÇÕES IRR FI | R\$ 27.767.520,90 | | | | |
| TOTAL art. 8º, inciso I, "a" | R\$ 73.895.018,69 | | | | |
| ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA | R\$ 10.665.485,89 | 30,57% | 30% | 30% | art. 8º, inciso II, "a" |
| BRABESCO FIA MID SMALL CAPS | R\$ 128.292.874,16 | | | | |
| BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA | R\$ 109.039.692,39 | | | | |
| CAIXA FI AÇÕES CONSUMO | R\$ 116.324.768,42 | | | | |
| ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI | R\$ 127.693.596,92 | | | | |
| ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC | R\$ 172.274.057,48 | | | | |
| ITAÚ SMALL CAP VALUATION | R\$ 55.061.046,42 | | | | |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA | R\$ 245.501.673,60 | | | | |
| BTG ABSOLUTO INST. FQ FIA | R\$ 315.688.693,03 | | | | |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES | R\$ 104.192.666,47 | | | | |
| SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO 30 | R\$ 48.825.960,46 | | | | |
| SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES | R\$ 72.548.595,13 | | | | |
| AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA | R\$ 84.713.090,08 | | | | |
| OCCAM FIC FIA | R\$ 106.163.566,71 | | | | |
| SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES | R\$ 33.658.143,72 | | | | |
| TOTAL art. 8º, inciso II, "a" | R\$ 1.726.643.910,88 | | | | |
| SAFRA S&P REALS PB FIC MULTIMERCADO | R\$ 21.663.161,64 | 0,38% | 1% | 3% | art. 8º, inciso III |
| TOTAL art. 8º, inciso III | R\$ 21.663.161,64 | | | | |
| BTG ECONOMIA REAL FIP | R\$ 5.569.463,88 | 0,10% | 1% | 5% | art. 8º, inciso IV, "a" |
| TOTAL art. 8º, inciso IV, "a" | R\$ 5.569.463,88 | | | | |
| TOTAL RENDA VARIÁVEL | R\$ 1.827.771.555,09 | 32,36% | | | |

| SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR | TOTAL | % DA CARTEIRA | ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020 | | Resolução CMN nº 3.922/2010 |
|--|-----------------------------|----------------|-----------------------------------|-----------------|-----------------------------|
| | | | LIMITE ALVO | LIMITE SUPERIOR | |
| BB MM GLOBAL SELECT | R\$ 44.046.955,17 | 1,86% | 2,5% | 10% | art. 9º, inciso II |
| SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXTERIOR | R\$ 61.275.973,24 | | | | |
| BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I | R\$ 70.397.488,98 | 2,95% | 2,5% | | art. 9º, inciso III |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I | R\$ 96.225.946,54 | | | | |
| TOTAL art. 9º - A | R\$ 271.946.373,93 | | | | |
| TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | R\$ 271.946.373,93 | 4,81% | | | |
| TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES | R\$ 5.648.364.305,47 | 100,00% | | | |

Quadro 40.

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

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

| SEGMENTO DE APLICAÇÃO | TOTAL | % CARTEIRA | Resolução CMN nº 3.922/2010 | |
|---|-----------------------------|------------|-----------------------------|--|
| BB PREVIDENCIÁRIO TP VII | R\$ 7.057.946,27 | 0,12% | 20% | |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 | R\$ 317.176.278,77 | 5,55% | | |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA | R\$ 582.852.669,05 | 10,20% | | |
| BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA | R\$ 105.039.692,39 | 1,84% | | |
| BB FIA BDR - NIVEL I | R\$ 70.397.488,98 | 1,23% | | |
| BB MM GLOBAL SELECT | R\$ 44.046.955,17 | 0,77% | | |
| CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP | R\$ 524.472.731,59 | 9,18% | | |
| CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF | R\$ 54.731.103,21 | 0,96% | | |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 89.848.523,89 | 1,57% | | |
| BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM | R\$ 9.324.667,93 | 0,16% | | |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5 | R\$ 60.806.397,84 | 1,06% | | |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA | R\$ 66.310.584,66 | 1,16% | | |
| BRADESCO INST IBR X ALPHA | R\$ 46.127.497,79 | 0,81% | | |
| BRADESCO FIA MID SMALL CAPS | R\$ 128.292.874,16 | 2,25% | | |
| ITAU INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC | R\$ 64.400.324,94 | 1,13% | | |
| CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA | R\$ 831.659.583,30 | 14,56% | | |
| ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA | R\$ 10.665.485,89 | 0,19% | | |
| ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC | R\$ 172.274.057,48 | 3,02% | | |
| ITAU SMALL CAP VALUATION | R\$ 55.061.046,42 | 0,96% | | |
| CAIXA FI AÇÕES CONSUMO | R\$ 116.324.768,42 | 2,04% | | |
| ITAU INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI | R\$ 127.693.596,92 | 2,24% | | |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA | R\$ 245.501.673,60 | 4,30% | | |
| ICATU VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP | R\$ 29.750.989,01 | 0,52% | | |
| ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF | R\$ 78.849.311,66 | 1,38% | | |
| ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF | R\$ 94.808.812,56 | 1,66% | | |
| ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FI | R\$ 27.767.520,90 | 0,49% | | |
| BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA | R\$ 315.688.693,03 | 5,53% | | |
| BTG ECONOMIA REAL FIP | R\$ 5.569.463,88 | 0,10% | | |
| SANTANDER CRESCE SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES | R\$ 72.548.595,13 | 1,27% | | |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES | R\$ 104.192.666,47 | 1,82% | | |
| SANTANDER SELEÇÃO 30 | R\$ 48.825.960,46 | 0,85% | | |
| SANTANDER GLOBAL EQUITY | R\$ 61.275.973,24 | 1,07% | | |
| SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO | R\$ 21.663.161,64 | 0,38% | | |
| SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF | R\$ 60.799.000,01 | 1,06% | | |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I | R\$ 96.225.956,54 | 1,68% | | |
| AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA | R\$ 84.713.090,08 | 1,48% | | |
| OCCAM FIC FIA | R\$ 106.163.566,71 | 1,86% | | |
| SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES | R\$ 33.658.143,72 | 0,59% | | |
| TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO | R\$ 4.972.566.853,71 | | | |

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 – Dezembro/2020

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

| FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14 | TOTAL APLICADO | CNPJ | PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$ | % DO PL DO FUNDO | Resolução CMN nº 3.922/2010 |
|---|-----------------------------|--------------------|-----------------------------------|------------------|-----------------------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022 | R\$ 7.057.946,27 | 19.523.305/0001-06 | R\$ 245.863.748,76 | 2,87% | 15% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 | R\$ 317.176.278,77 | 13.322.205/0001-35 | R\$ 8.476.640.994,51 | 3,74% | |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA | R\$ 582.852.669,05 | 25.078.994/0001-90 | R\$ 9.568.490.825,39 | 6,09% | |
| BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA | R\$ 105.039.692,39 | 29.258.294/0001-38 | R\$ 1.169.052.019,30 | 8,99% | |
| BB FIA BDR - NIVEL I | R\$ 70.397.488,98 | 21.470.644/0001-13 | R\$ 647.569.267,65 | 10,87% | |
| BB MM GLOBAL SELECT | R\$ 44.046.955,17 | 17.413.636/0001-68 | R\$ 1.391.937.780,06 | 3,16% | |
| BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 89.848.523,89 | 08.246.263/0001-97 | R\$ 422.999.839,93 | 21,24% | |
| BRDESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM | R\$ 9.324.667,93 | 03.399.411/0001-90 | R\$ 3.168.557.239,02 | 0,29% | |
| BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5 | R\$ 60.806.397,84 | 20.216.216/0001/04 | R\$ 954.945.016,55 | 6,37% | |
| BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA | R\$ 66.310.584,66 | 28.515.874/0001-09 | R\$ 1.422.915.185,87 | 4,66% | |
| BRDESCO INST IBR X ALPHA | R\$ 46.127.497,79 | 14.099.976/0001-78 | R\$ 595.178.322,17 | 7,75% | |
| BRDESCO FIA MID SMALL CAPS | R\$ 128.292.874,16 | 06.988.623/0001-09 | R\$ 2.180.561.264,94 | 5,88% | |
| CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP | R\$ 524.472.731,59 | 11.060.913/0001-10 | R\$ 20.761.505.098,56 | 2,53% | |
| CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF | R\$ 54.731.103,21 | 22.791.074/0001-26 | R\$ 223.356.568,60 | 24,50% | |
| CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA | R\$ 831.659.583,30 | 23.215.097/0001-55 | R\$ 14.722.139.597,34 | 5,65% | |
| CAIXA FI AÇÕES CONSUMO | R\$ 116.324.768,42 | 10.577.512/0001-79 | R\$ 773.737.678,54 | 15,03% | |
| ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC | R\$ 64.400.324,94 | 21.838.150/0001-49 | R\$ 3.882.685.363,65 | 1,66% | |
| ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA | R\$ 10.665.485,89 | 08.817.414/0001-10 | R\$ 970.856.600,60 | 1,10% | |
| ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI | R\$ 127.693.596,92 | 23.731.629/0001-07 | R\$ 1.462.115.658,32 | 8,73% | |
| ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC | R\$ 172.274.057,48 | 24.571.992/0001-75 | R\$ 3.595.641.284,57 | 4,79% | |
| ITAÚ SMALL CAP VALUATION | R\$ 55.061.046,42 | 01.063.897/0001-65 | R\$ 1.248.048.647,45 | 4,41% | |
| SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO 30 | R\$ 48.825.960,66 | 29.549.642/0001-26 | R\$ 1.729.254.395,74 | 2,82% | |
| SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES | R\$ 72.548.595,13 | 02.436.763/0001-05 | R\$ 601.590.009,52 | 12,06% | |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES | R\$ 104.192.666,47 | 01.699.688/0001-02 | R\$ 714.586.579,89 | 14,58% | |
| SANTANDER GLOBAL EQUITY | R\$ 61.275.973,24 | 17.804.792/0001-50 | R\$ 1.055.348.442,07 | 5,81% | |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA | R\$ 245.501.673,60 | 08.279.304/0001-41 | R\$ 1.793.128.513,73 | 13,69% | |
| ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF | R\$ 78.849.311,66 | 10.922.432/0001-03 | R\$ 872.184.819,46 | 9,04% | |
| ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF | R\$ 94.808.812,56 | 10.756.541/0001-06 | R\$ 924.231.847,02 | 10,26% | |
| ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FI | R\$ 27.767.520,90 | 06.224.719/0001-92 | R\$ 130.863.906,84 | 21,22% | |
| SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF | R\$ 60.799.000,01 | 30.659.168/0001-74 | R\$ 1.813.956.117,79 | 3,35% | |
| BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA | R\$ 315.688.693,03 | 11.977.794/0001-64 | R\$ 2.636.774.357,29 | 11,97% | |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I | R\$ 96.225.956,54 | 19.436.818/0001-80 | R\$ 1.875.936.369,20 | 5,13% | |
| AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA | R\$ 84.713.090,08 | 34.791.108/0001-61 | R\$ 1.917.361.908,11 | 4,42% | |
| OCCAM FIC FIA | R\$ 106.163.566,71 | 11.628.883/0001-03 | R\$ 1.060.739.165,08 | 10,01% | |
| SUL AMERICA EQUITIES FI AÇÕES | R\$ 33.658.143,72 | 11.458.144/0001-02 | R\$ 1.012.301.864,05 | 3,32% | |
| TOTAL | R\$ 4.915.583.239,18 | | | | |

| 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 PH FIC MULTIMERCADO | R\$ 21.663.161,64 | 21.595.829/0001-54 | R\$ 734.034.454,86 | 2,95% | 5% |
| BTG ECONOMIA REAL FIP | R\$ 5.569.463,88 | 35.640.811/0001-31 | R\$ 361.122.940,75 | 1,54% | |
| ICATU VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP | R\$ 29.750.989,01 | 19.719.727/0001-51 | R\$ 825.779.381,34 | 3,60% | |
| TOTAL | R\$ 56.983.614,53 | | | | |

| | |
|--------------|-----------------------------|
| TOTAL | R\$ 4.972.566.853,71 |
|--------------|-----------------------------|

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 – Dezembro/2020

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

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

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

Nota 5: Os fundos Bradesco Institucional IBRx Alpha e AZ Quest Small Mid Caps possuem recursos aplicados da Amazonprev que superam 15% do total do Patrimônio Líquido nesses fundos. No entanto, são fundos que compram cotas de outros fundos (FIC de FI) e dessa forma não registram Desenquadramento nesse artigo, pois as informações repassadas para a SPPS através do sistema DAIR referem-se aos PLs dos fundos Master.

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

| GESTOR DE RECURSOS | TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA NOVEMBRO/2020) EM R\$ MI | APLICAÇÕES - AMAZONPREV (DEZEMBRO/2020) | % DE RECURSOS SOB GESTÃO | Resolução CMN nº 3.922/2010 |
|------------------------------|---|---|--------------------------|-----------------------------|
| BB DTVM S A | R\$ 1.150.595,34 | R\$ 1.126.571.030,63 | 0,0979% | 5% |
| ITAU UNIBANCO SA | R\$ 733.407,35 | R\$ 430.094.511,65 | 0,0586% | |
| BRADESCO | R\$ 526.725,22 | R\$ 400.710.546,27 | 0,0761% | |
| CAIXA | R\$ 400.300,08 | R\$ 1.527.188.186,52 | 0,3815% | |
| BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A | R\$ 293.673,11 | R\$ 286.843.195,30 | 0,0977% | |
| BANCO BTG | R\$ 131.091,90 | R\$ 321.258.156,91 | 0,2451% | |
| BANCO SAFRA | R\$ 105.781,36 | R\$ 178.688.118,19 | 0,1689% | |
| SULAMERICA INVESTIMENTOS | R\$ 29.614,03 | R\$ 33.658.143,72 | 0,1137% | |
| ICATU VANGUARDA DTVM S/A | R\$ 29.345,73 | R\$ 476.678.307,73 | 1,6244% | |
| AZ QUEST INVESTIMENTOS | R\$ 16.296,64 | R\$ 84.713.090,08 | 0,5198% | |
| OCCAM BRASIL GESTÃO | R\$ 14.171,91 | R\$ 106.163.566,71 | 0,7491% | |

Quadro 43.

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

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

DISTRIBUIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR GESTOR DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS

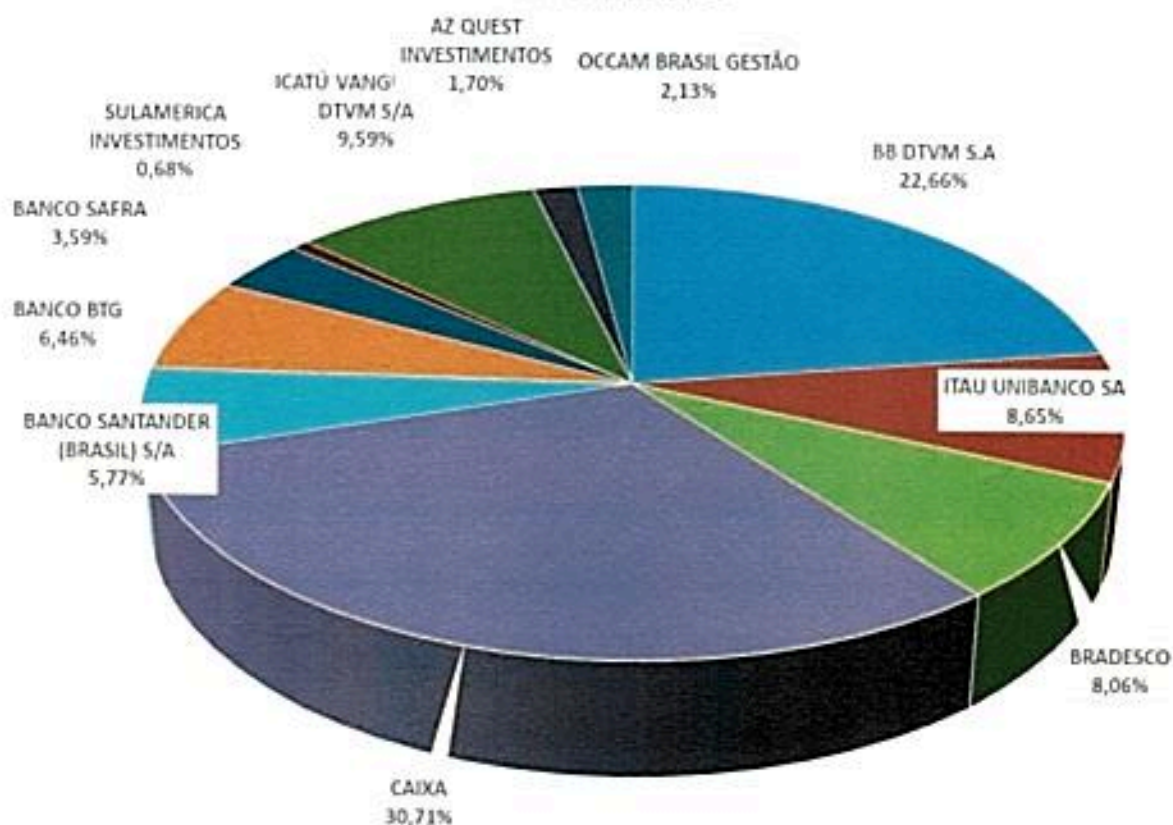


Gráfico 4.

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

| DESCRIÇÃO | SALDO |
|----------------------------|----------------------------|
| FUNDOS DE INVESTIMENTO | RS 4.972.566.853,72 |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B | RS 675.797.451,76 |
| TÍTULOS - CVS | RS 10.448.795,60 |
| IMÓVEIS | RS 51.536.297,82 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | RS 1.337.337,37 |
| TOTAL | RS 5.711.686.736,27 |

Quadro 44.

EVOLUÇÃO DOS RECURSOS - AMAZONPREV

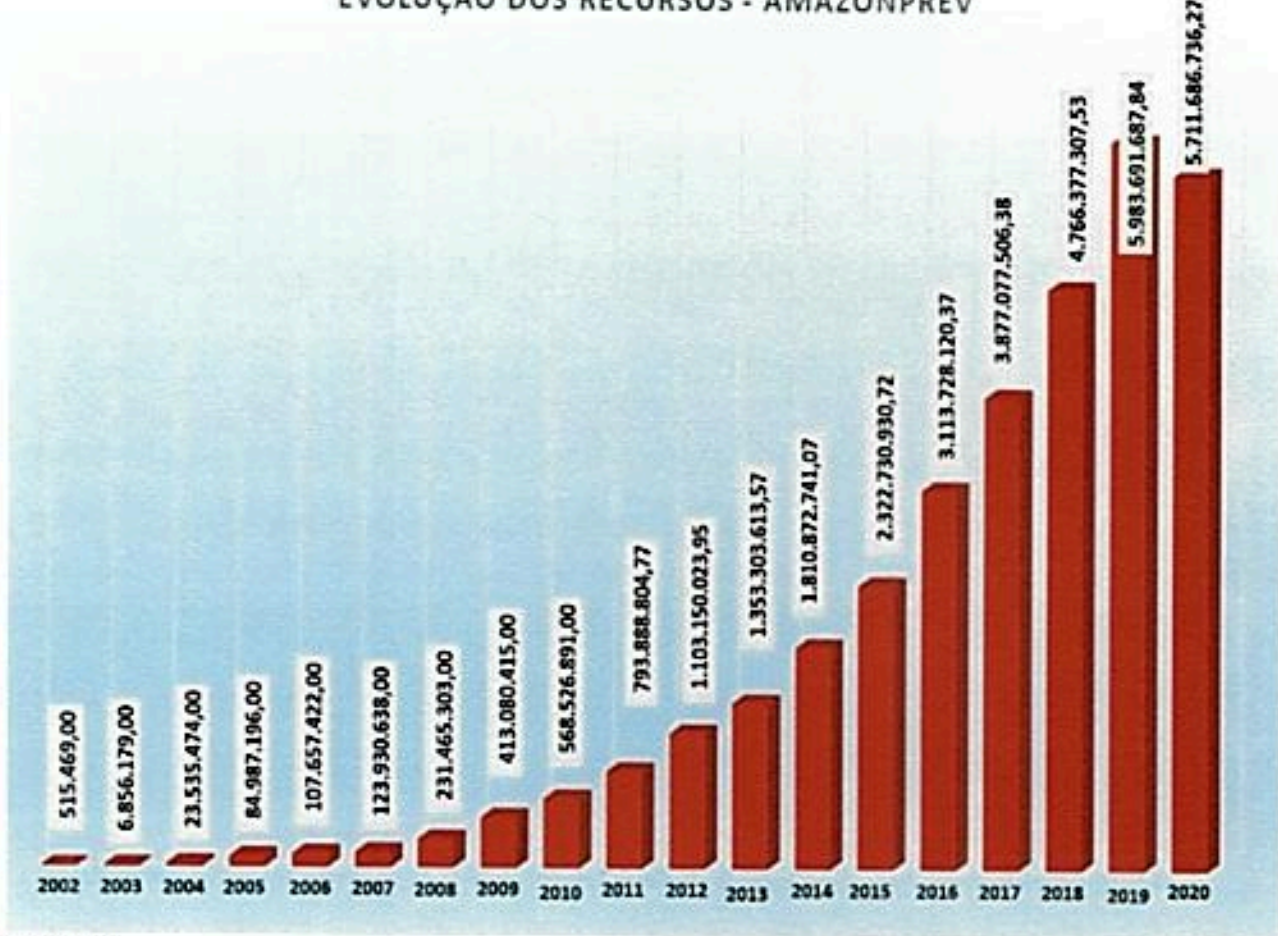


Gráfico 5.

Nota: Com base nos termos da LC 206/2020 que, dentre outros, cria o Fundo Temporário - FTEMP a partir dos recursos de contribuição dos servidores militares do FPREV, com finalidade de pagamento dos inativos e pensionistas do FFIN e do FPPM. O valor total a ser utilizado no FTEMP é de R\$ 1,088 bilhão, que dessa forma reduzirá os resultados da carteira de investimentos da Amazonprev.

13. PLANO DE AÇÃO MENSAL

| PLANO DE AÇÃO MENSAL | | RESPONSÁVEL | PRAZO |
|---|---|--|------------|
| FPREV EXECUTIVO: | Novos Recursos: Direcionar para o fundo Schroder e IDKA 2 BB | GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV | 15/02/2021 |
| | Demais Recursos: | | |
| | Caixa Consumo: resgatar 30 MM tratar entre schroder e idka BB | | |
| | SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES: resgate 20 MM direciona STDR GLOBAL | | |
| | Ícetu Dividendos: direcionar 30 MM para BB Global | | |
| FPREV ALE: | Novos Recursos: Direcionar para o Safrá Consumo | GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV | 15/02/2021 |
| FPREV MPE/PGJ: | Novos Recursos: Direcionar para o fundo BB Global | GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV | 15/02/2021 |
| | Migrar R\$ 20 MM BB Alocação ativa para BB Ações Valor | GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV | 15/02/2021 |
| FPREV - DPE/AM | Novos Recursos: Direcionar para o Fundo CAIXA Gestão Estratégica | GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV | 15/02/2021 |
| FPREV - TJA/AM | Novos Recursos: Direcionar para o fundo BB Global | GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV | 15/02/2021 |
| | Migrar R\$ 40 MM BB Alocação ativa para o BB Global e BB IDKA 2 | | |
| FPREV - TCE/AM | Novos Recursos: Direcionar para o fundo BB Global | GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV | 15/02/2021 |
| FFIN (Executivo, ALE, TCE, TJA, MPE, DPE) | Aplicar os recursos no fundo Bradesco Maxi Poder Público, facilitando a operacionalização dos pagamentos das folhas de inativos e pensionistas desses órgãos. Devem ser observados os limites para aplicação conforme legislação vigente. | GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV | 15/02/2021 |
| RECURSOS COMPREV | Manter os recursos aplicados no fundo Bradesco Alocação Dinâmica, de forma manter o enquadramento dos recursos da Amazonprev | GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV | 15/02/2021 |
| 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 | 15/02/2021 |

Quadro 45.

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



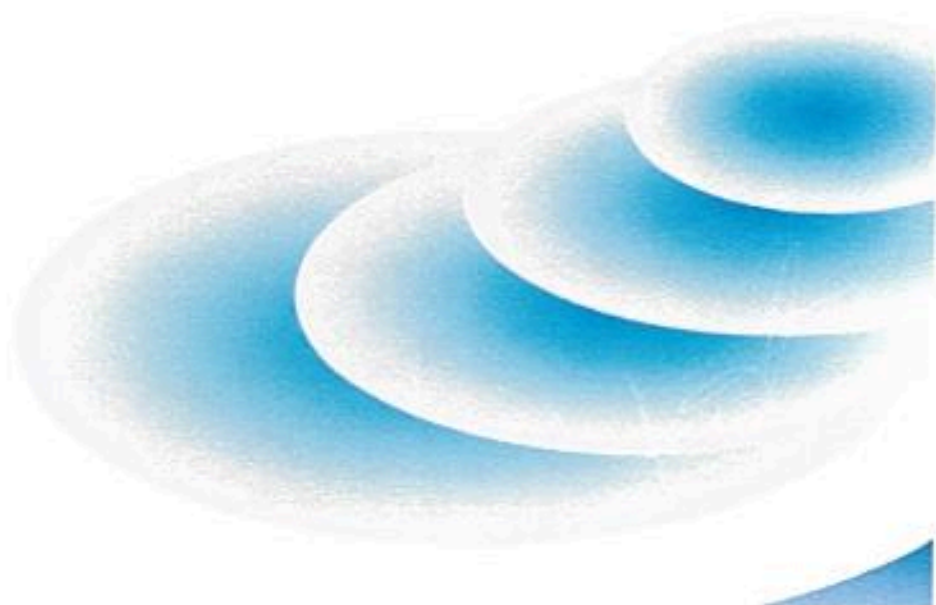
AMAZONPREV

Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



RELATÓRIOS - 2020

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



Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

| SALDOS E PERFORMANCE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO - FPREV AMAZONPREV | TOTAL APLICADO | Volatilidade 12M | VaR 95% 12M | Máx Drawdown 12M | 12M | dez20 | 2020 |
|--|-----------------------------|------------------|-------------|------------------|---------|---------|---------|
| | | | | | RETORNO | RETORNO | RETORNO |
| BB Prev RF Alocacao Ativa FcFI | R\$ 382.852.669,05 | 6,25% | 0,64% | -5,49 | 5,09% | 2,38% | 5,09% |
| BB Prev RF Tr Publ VII FI | R\$ 7.057.946,27 | 2,43% | 0,25% | -2,66 | 5,61% | 1,21% | 5,61% |
| Bradesco Fc FI RF Alocacao Dinamica | R\$ 60.985.284,88 | 6,90% | 0,71% | -5,88 | 4,66% | 2,48% | 4,66% |
| Bradesco Inst FICFI RF Imo B 5 | R\$ 60.806.397,84 | 5,37% | 0,55% | -5,66 | 7,86% | 1,78% | 7,86% |
| Bradesco FI RF Maxi Poder Publico | R\$ 2.002.164,94 | 0,32% | 0,03% | -0,53 | 2,15% | 0,18% | 2,15% |
| Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF | R\$ 54.731.103,21 | 9,24% | 0,95% | -10,12 | 3,81% | 2,53% | 3,81% |
| FI Caixa Brasil Imo B 5 Tp RF LP | R\$ 524.472.731,59 | 5,01% | 0,51% | -5,40 | 7,75% | 1,82% | 7,75% |
| Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF | R\$ 794.651.183,95 | 5,93% | 0,61% | -4,27 | 6,66% | 1,32% | 6,66% |
| Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP | R\$ 29.750.989,01 | 6,07% | 0,62% | -6,53 | 7,60% | 2,37% | 7,60% |
| Icatu Vanguardia Inflacao Curta FI RF LP | R\$ 78.849.311,66 | 5,22% | 0,54% | -5,56 | 7,65% | 1,81% | 7,65% |
| Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP | R\$ 94.808.812,56 | 19,82% | 2,04% | -18,81 | 5,10% | 7,50% | 5,10% |
| Itau Inst Alocacao Dinamica RF FICFI | R\$ 64.400.324,94 | 1,66% | 0,17% | -1,57 | 2,86% | 0,20% | 2,86% |
| Safrá Imo Institucional Fc FI RF | R\$ 60.799.000,01 | 14,65% | 1,51% | -13,28 | 7,60% | 5,56% | 7,60% |
| BB Prev RF Idca 2 FI | R\$ 317.176.278,77 | 4,19% | 0,43% | -4,46 | 7,92% | 1,53% | 7,92% |
| TOTAL | R\$ 2.733.344.198,68 | | | | | | |

| FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL | TOTAL APLICADO | Volatilidade 12M | VaR 95% 12M | Máx Drawdown 12M | 12M | dez20 | 2020 |
|--|-----------------------------|------------------|-------------|------------------|---------|---------|---------|
| | | | | | RETORNO | RETORNO | RETORNO |
| BB Acoes Valor Fc FIA | R\$ 105.039.692,39 | 42,08% | 4,29% | -44,79 | 5,98% | 10,72% | 5,98% |
| BB Mult Global Select Equiv Ic FI | R\$ 44.046.955,17 | 27,77% | 2,87% | -22,73 | 51,88% | 1,09% | 51,88% |
| BB Acoes Eq FIA - Bdr Nivel I | R\$ 70.397.488,98 | 29,04% | 3,03% | -17,19 | 49,32% | 0,68% | 49,32% |
| Bradesco FIA Mid Smal Caps | R\$ 128.292.874,16 | 44,02% | 4,44% | -1,08 | -1,90% | 8,61% | -1,90% |
| Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha | R\$ 34.706.335,56 | 44,21% | 4,48% | -46,69 | 4,62% | 9,43% | 4,62% |
| BTG Pactual Absokto Inst FIC FIA | R\$ 315.688.693,03 | 45,96% | 4,65% | -45,47 | 7,88% | 5,23% | 7,88% |
| BTG Pactual Economia Real FIP | R\$ 5.569.463,88 | | | | | | |
| Caixa FIA Consumo | R\$ 116.324.768,42 | 46,19% | 4,66% | -1,01 | -0,57% | 4,89% | -0,57% |
| Icatu Vanguardia Acoes Ibrx FI | R\$ 27.767.520,90 | 45,47% | 4,61% | -47,90 | 4,02% | 9,28% | 4,02% |
| Icatu Vanguardia Dividendos FIA | R\$ 245.501.673,60 | 40,11% | 4,08% | -1,59 | -9,45% | 7,96% | -9,45% |
| Itau Acoes Duráveis Fc | R\$ 172.274.057,48 | 44,11% | 4,48% | -1,54 | -4,87% | 6,30% | -4,87% |
| Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI | R\$ 10.665.485,89 | 44,49% | 4,51% | -1,31 | 2,14% | 8,37% | 2,14% |
| Itau Institucional Acoes Phoenix Fc FI | R\$ 127.693.596,92 | 52,53% | 5,29% | -1,53 | -21,23% | 7,97% | -21,23% |
| Itau Smal Cap Master FIA | R\$ 55.061.046,42 | 47,14% | 4,74% | -0,62 | -1,64% | 7,74% | -1,64% |
| Santander Seleção Crescimento Senior Ações FICFI | R\$ 72.548.595,13 | 43,60% | 4,41% | -2,20 | -6,07% | 7,61% | -6,07% |
| Santander FI Ibovespa Ativo Inst Acoes | R\$ 104.192.666,47 | 45,49% | 4,60% | -2,26 | -5,69% | 7,43% | -5,69% |
| Santander Seleção Crescimento Ações FICFI | R\$ 48.825.960,46 | 43,56% | 4,41% | -2,20 | -6,12% | 7,62% | -6,12% |
| Santander Global Equities Dólar Master Mult Ic FI | R\$ 61.275.973,24 | 23,66% | 2,45% | -19,06 | 61,34% | 0,48% | 61,34% |
| Safrá S P Reas Pb FI Mult | R\$ 21.663.161,63 | 32,70% | 3,36% | -34,78 | 12,58% | 3,07% | 12,58% |
| Safrá Consumo Americano FIA Bdr Nivel I | R\$ 96.225.956,54 | 33,01% | 3,41% | -22,47 | 44,45% | 0,35% | 44,45% |
| Az Quest Smal Mid Caps Inst Fc de FIA | R\$ 84.713.090,08 | 46,43% | 4,66% | -0,59 | -4,03% | 6,93% | -4,03% |
| Occam Fc de FIA | R\$ 106.163.566,71 | 41,97% | 4,27% | -44,74 | 7,87% | 10,11% | 7,87% |
| Sul America Equities FIA | R\$ 33.658.143,72 | 48,16% | 4,85% | -1,07 | -12,57% | 7,70% | -12,57% |
| TOTAL | R\$ 2.088.296.766,80 | | | | | | |

Quadro 1.

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

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

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

Nota 3: DRAWDOWN: Auxilia a determinar o risco de um investimento ao medir seu declínio desde o valor máximo alcançado pelo ativo, até o valor mínimo atingido em determinado período de tempo. Para determinar o percentual de queda, o Draw-Down é medido desde que a desvalorização começa até se atingir um novo ponto de máximo, garantindo, dessa forma, que a mínima da

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

série representa a maior queda ocorrida no período. Quanto mais negativo o número, maior a perda ocorrida e, conseqüentemente, maior o risco do ativo. Já um Draw-Down igual a zero, indica que não houve desvalorização do ativo ao longo do período avaliado.

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

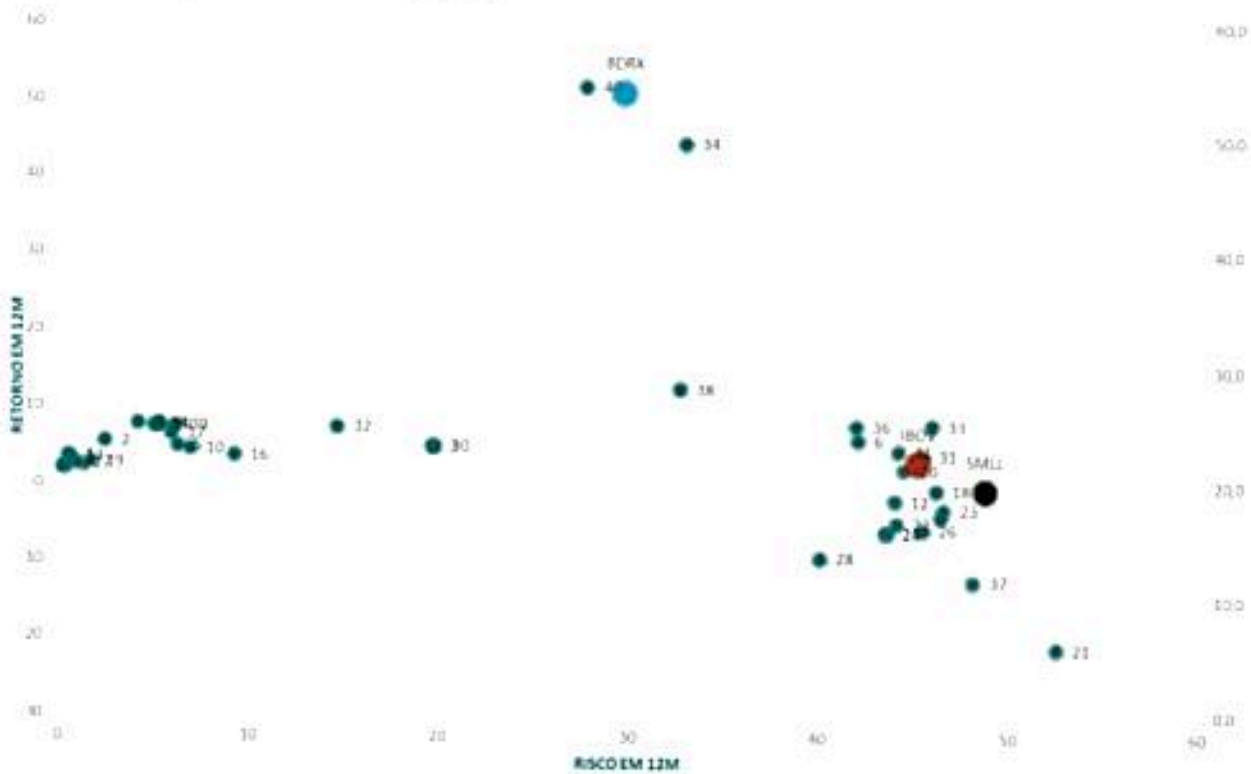


Gráfico 1: Análise Risco x Retorno (12 M)

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

| Nº | Fundos | Retorno | Volatilidade |
|----|--|---------|--------------|
| 1 | BB Prev RF Irf M1 Tit Publ Fc | 3,47 | 0,57 |
| 2 | BB Prev RF Tit Publ VII FI | 5,61 | 2,43 |
| 3 | BB Prev RF Ima-B5+ Tp FI | 5,06 | 19,66 |
| 4 | BB Prev RF Idka 2 FI | 7,92 | 4,19 |
| 5 | BB Prev RF Alocação Ativa Fcfi | 5,09 | 6,25 |
| 6 | BB Acoes Valor Fc FIA | 5,98 | 42,08 |
| 7 | Bradesco FI RF Maxi Poder Publico | 2,15 | 0,32 |
| 8 | Bradesco FI RF Ref DI Premium | 2,13 | 0,26 |
| 9 | Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5 | 7,86 | 5,37 |
| 10 | Bradesco Fc FI RF Alocação Dinamica | 4,66 | 6,90 |
| 11 | Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha | 4,62 | 44,21 |
| 12 | Bradesco FIA Mid Small Caps | -1,90 | 44,02 |
| 13 | FI Caixa Brasil Irf M 1 Tp RF | 3,63 | 0,55 |
| 14 | FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP | 7,75 | 5,01 |
| 15 | Caixa FI Brasil 2020 V Tp RF | | |
| 16 | Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF | 3,81 | 9,24 |
| 17 | Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF | 6,66 | 5,93 |
| 18 | Caixa FIA Consumo | -0,57 | 46,19 |
| 19 | Itau Instit Alocação Dinamica RF FICFI | 2,86 | 1,66 |
| 20 | Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI | 2,14 | 44,49 |
| 21 | Itau Institucional Acoes Phoenix Fc FI | -21,23 | 52,53 |
| 22 | Itau Acoes Dunamis Fc | -4,87 | 44,11 |
| 23 | Small Cap Valuation Fc Acoes | -3,08 | 46,60 |
| 24 | Santander Seleção Crescimento Ações FICFI | -6,12 | 43,56 |
| 25 | Santander Seleção Crescimento Senior Ações I | -6,07 | 43,60 |
| 26 | Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes | -5,69 | 45,49 |
| 27 | Santander RF Ativo Fc FI | 2,70 | 0,99 |
| 28 | Icatu Vanguarda Dividendos FIA | -9,45 | 40,11 |
| 29 | Icatu Vanguarda Inflação Curta FI RF LP | 7,65 | 5,22 |
| 30 | Icatu Vang Inflação Longa FI RF LP | 5,10 | 19,82 |
| 31 | Icatu Vanguarda Acoes Ibx FI | 4,02 | 45,47 |
| 32 | Safra Ima Institucional Fc FI RF | 7,60 | 14,65 |
| 33 | BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA | 7,88 | 45,96 |
| 34 | Safra Consumo Americano FIA Bdr Nivel I | 44,45 | 33,01 |
| 35 | Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA | -4,03 | 46,43 |
| 36 | Occam Fc de FIA | 7,87 | 41,97 |
| 37 | Sul America Equities FIA | -12,57 | 48,16 |
| 38 | Safra S P Reals Pb FI Mult | 12,58 | 32,70 |
| 39 | Icatu Vang FI RF Inflação Cred Priv LP | 7,60 | 6,07 |
| 40 | BB Mult Global Select Equity Ie FI | 51,88 | 27,77 |
| 41 | BTG Pactual Economia Real FIP | | |

Quadro 2. Legenda Gráfico 1.



2. VERIFICAÇÃO DE LASTRO DOS FUNDOS DE RISCO DE CRÉDITO

DATA BASE EM 31.12.20

| TABELA - DURATION & YIELD POR CLASSE | | | |
|--------------------------------------|-------------|--------------|---------------|
| Ativo | Duration | Spread | % PL |
| DEB | 3,41 | 2,10% | 57,2% |
| CB1 | 0,00 | 0,00% | 0,0% |
| LF | 2,39 | 1,90% | 9,2% |
| CDB | 0,00 | 0,00% | 0,0% |
| DPGE | 0,00 | 0,00% | 0,0% |
| NP | 1,48 | 1,85% | 1,2% |
| BOND | 0,00 | 0,00% | 0,0% |
| FIDC | 0,00 | 0,00% | 0,0% |
| NTN-B | 3,94 | - | 27,6% |
| Over | 0,00 | - | 4,2% |
| Carteira Crédito | 3,23 | 2,06% | 68,2% |
| Crédito - Contribuição Fundo | 0,96 | 1,41% | 68,2% |
| Fundo (Inclui DAP e NTN-B) | 2,43 | 1,41% | 100,0% |

Quadro 03

| TABELA - RATING EXTERNO* | | |
|--------------------------|--------------------|---------------|
| Rating | Financeiro | % PL |
| AAA | 103 058 071 | 22,2% |
| AA+ | 90 733 303 | 11,0% |
| AA | 136 899 972 | 16,6% |
| AA- | 42 550 064 | 5,2% |
| A+ | 61 074 433 | 7,4% |
| DPGE | 0 | 0,0% |
| A | 0 | 0,0% |
| A- | 13 129 249 | 1,6% |
| BBB+ | 0 | 0,0% |
| BBB | 0 | 0,0% |
| BBB- | 0 | 0,0% |
| BB+ | 0 | 0,0% |
| BB | 0 | 0,0% |
| BB- | 0 | 0,0% |
| B+ | 0 | 0,0% |
| B | 0 | 0,0% |
| B- | 9 491 007 | 1,1% |
| CCC | 0 | 0,0% |
| CC | 0 | 0,0% |
| C | 0 | 0,0% |
| Sem Rating | 26 082 743 | 3,2% |
| Tesouro / Over | 262 900 810 | 31,8% |
| Total | 825.720.536 | 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 | 147 437 807 | 17,9% |
| Bancos | 80 094 194 | 9,8% |
| Conc. Rodoviárias | 79 421 455 | 9,6% |
| Serviço | 67 746 757 | 8,2% |
| Saneamento | 64 777 004 | 7,8% |
| Varejo | 44 506 229 | 5,4% |
| Shopping Center | 34 242 105 | 4,1% |
| Mineração e Siderurgia | 11 521 269 | 1,4% |
| Logística | 9 874 566 | 1,2% |
| Óleo e Gás | 7 507 606 | 0,9% |
| Indústria e Comércio | 5 242 044 | 0,6% |
| Papel e Celulose | 4 043 431 | 0,5% |
| Holding | 3 094 118 | 0,4% |
| Infraestrutura | 2 510 351 | 0,3% |
| Tesouro / Over | 262 900 810 | 31,8% |
| Total | 825.720.536 | 100,0% |

Quadro 05.

Nota: Dados referentes ao fundo ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CREDITO PRIVADO LP. (base: 30/11/2020)

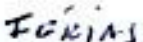
PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 15 de Janeiro de 2021, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de Dezembro/2020, com o acompanhamento da Rentabilidade e Risco das diversas modalidades de operações realizadas nas aplicações dos recursos do RPPS.

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

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

Manaus – AM, 15 de janeiro de 2021.


Alan Nascimento
Coordenador

Bruno Costa Novo
Secretário


Bruno Barroso
Membro


Leonardo Cavalcanti
Membro


Andreza de Souza Silva
Membro


Claudinei Soares
Membro


André Luiz Bentes
Membro


Marcos Souza
Membro

APROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL - COFIS

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

APROVAÇÃO

REJEIÇÃO

Data:

Membros do Conselho Fiscal:

APROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL - CONAD

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

APROVAÇÃO

REJEIÇÃO

Data:

Membros do Conselho de Administração: