

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

Destino: DIRAF / PRESI

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

Data: 16/03/2020

RELATÓRIO Nº. 013/2020 – COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **Fevereiro/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 12)
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 12 a 14)
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (página 14)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (página 15 a 16)
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (página 16)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (páginas 17 a 18)
- 8) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado – FPREV (página 19)
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro: Executivo, DPE, ALE e MPE – (páginas 20 a 21)
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 21)
- 11) Outros Recursos do Tribunal de Justiça – TJ/AM: Saldos e Composição (páginas 22)
- 12) Outros Recursos Tribunal de Contas do Estado - TCE: Saldos e Composição (página 22)
- 13) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 23 a 26)
- 14) Total consolidado e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 27 a 28)
- 15) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 29)
- 16) Relatório de Risco dos Ativos (páginas 30 a 34).
- 17) Verificação de Lastro dos Fundos de Risco de Crédito (página 35)
- 18) Parecer do Comitê de Investimentos (página 36).
- 19) Aprovação do Conselho Fiscal (página 37).



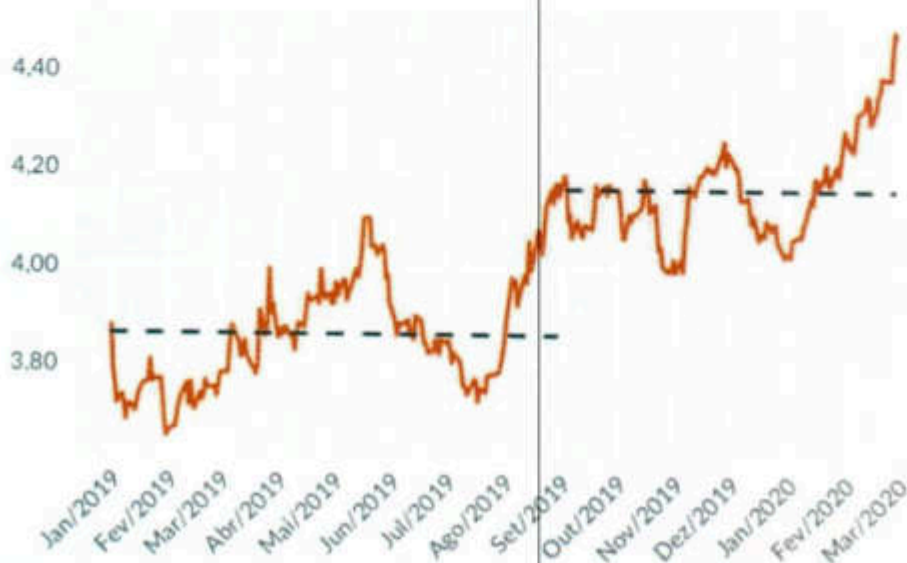
Handwritten signatures and initials in blue ink at the bottom right of the page.

1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

Registrado pelo Relatório InterView Março/2020, emitido pelo Banco Inter.

“Uma crescente aversão a risco marcou o mês de fevereiro no cenário global. Os mercados internacionais e no Brasil apresentaram uma alta volatilidade no mês de fevereiro, com quedas significativas nas bolsas e uma fuga geral para ativos de menor risco, como títulos de governo. Esse movimento de realização foi causado pelas incertezas em relação ao impacto do Corona Vírus, que nas últimas semanas se espalhou além da China para Itália, Coreia do Sul e Japão, países importantes na cadeia de produção global, o que pode gerar um impacto maior na desaceleração da atividade econômica. No entanto, acreditamos que esse impacto econômico será conjuntural, ou seja, à medida que a epidemia seja controlada e eventualmente com a chegada da vacina, a atividade tende a se recuperar e seguir a tendência anterior de um crescimento mais moderado.”

DOLAR



Fonte: BCB, Banco Inter

“O câmbio teve mais uma desvalorização de 4% no mês e acumula alta de 10% no ano. O movimento do dólar seguiu a saída de investimentos de maior risco, principalmente por parte do investidor estrangeiro. Parte desse movimento pode ser revertido nas próximas semanas quando tivermos maior clareza sobre o impacto econômico. No entanto, como já mencionamos anteriormente, a taxa de câmbio hoje está em um novo patamar, que acreditamos ser mais próximo de cerca de R\$4,20, contra R\$3,85 como foi no 1º semestre de 2019. Essa mudança reflete a queda

(Assinaturas manuais)

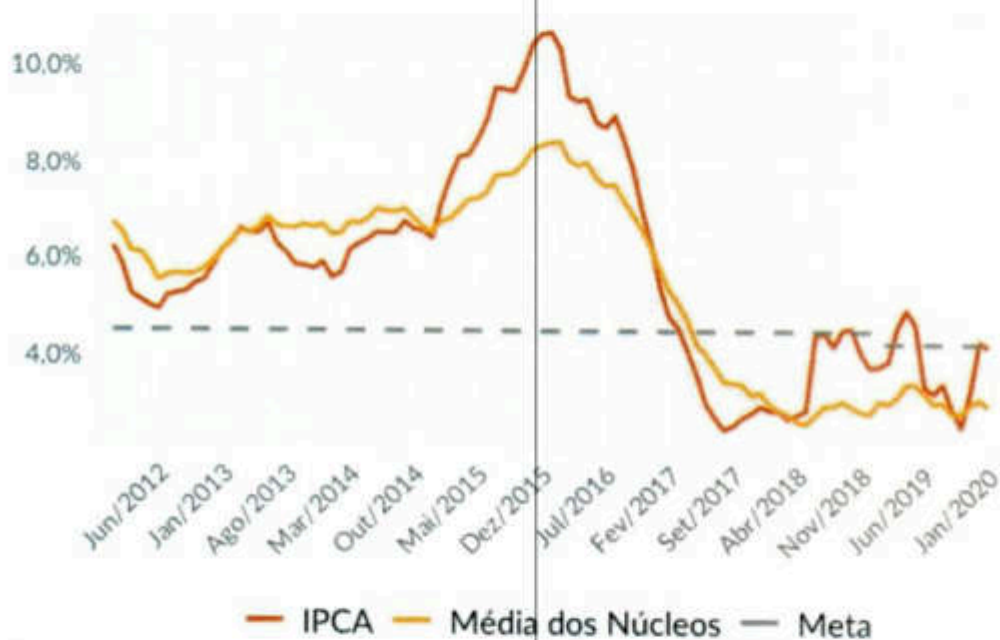
Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

dos juros no Brasil, desde o início do ciclo de cortes da Selic em julho de 2019. No entanto, esperamos que a maior volatilidade continue, considerando que ainda há alguma incerteza com relação ao impacto da nova gripe na economia global.”

“A balança comercial brasileira já apresenta um resultado mais fraco, reflexo da menor demanda da China. Após uma queda mais significativa das exportações em janeiro, a balança comercial mostrou uma recuperação em fevereiro e apresentou superávit de cerca de US\$3 bilhões. A balança brasileira pode seguir com uma tendência mais positiva, uma vez que a alta do dólar tende a favorecer as exportações, principalmente de commodities agrícolas, para os países mais afetados pelas paralizações.

Atividade econômica brasileira deve apresentar uma desaceleração conjuntural nos próximos meses, mas a tendência ainda é de uma recuperação cíclica. O PIB do 4º trimestre, que será divulgado essa semana, deve apontar um crescimento de cerca de 0,5% no trimestre, encerrando o ano com alta de 1,2%. O cenário internacional mais negativo deve impactar o crescimento dos investimentos e juntamente com a redução dos gastos do governo ainda devem contribuir de forma restritiva para o PIB e com isso, estimamos um crescimento menor, de cerca de 2,2% em 2020.”

INFLAÇÃO



Fonte: IBGE, Banco Inter

“Apesar da alta do dólar, a inflação deve se manter controlada. O IPCA mantém a tendência de desaceleração, como vimos na prévia em fevereiro que ficou em 0,20%. A redução dos preços dos alimentos, após a forte alta no final de 2019, e a bandeira verde nas tarifas de energia contribuíram para a contenção do índice de preços. Para os próximos meses, os preços das commodities em baixa.

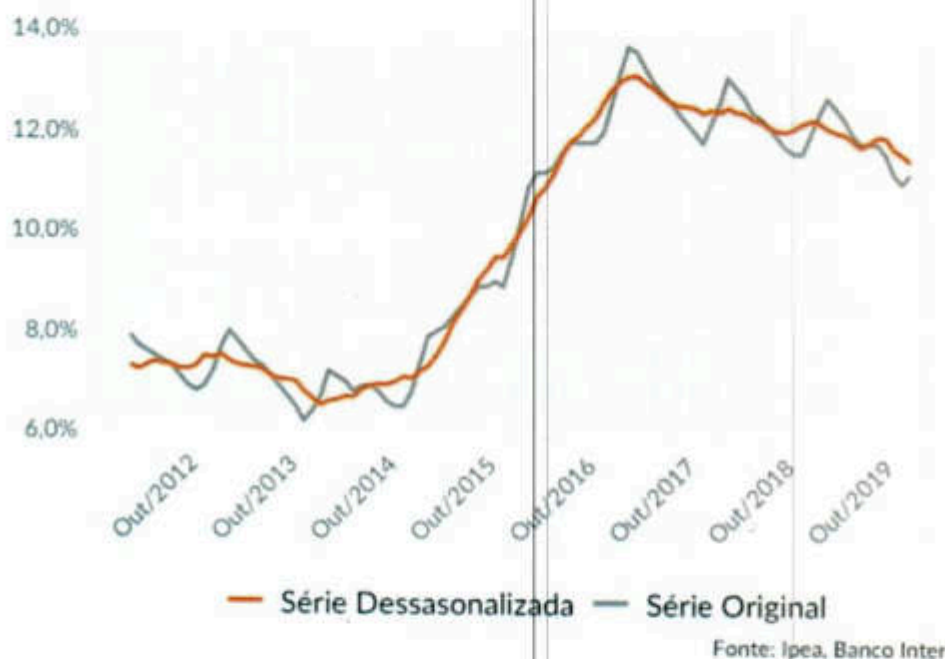
[Assinaturas manuscritas]

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

principalmente do petróleo, devem mais que compensar a alta do dólar e não esperamos que o IPCA apresente alta significativa, devendo permanecer abaixo da meta em 2020. De fato, a crise causada pela epidemia do Corona vírus tende a ser deflacionária devido ao seu impacto na demanda internacional.

A maior aversão a risco nos mercados de ações e a forte alta do dólar não afetou as taxas de juros no Brasil tiveram nova queda. Diferentemente de outros momentos de crise e aversão a risco, as taxas de juros no Brasil apresentaram uma nova queda, principalmente para o curto e médio prazo. O mercado passou a precificar uma nova redução da Selic em 0,25% a partir de março. Apesar da ata do Copom ter indicado que a última redução da Selic representava o fim do ciclo, acreditamos que, caso o cenário para a inflação se mantenha em baixa com IPCA projetado para o ano em 3,2% mesmo com o dólar a R\$4,5, o Banco Central poderia rever sua decisão e considerar um novo corte, adicionando mais um estímulo para contrabalancear o cenário de atividade mais fraca que o esperado anteriormente. A expectativa dos mercados pela redução de juros não ocorre somente no Brasil. Nos EUA, também é esperada que o Fed reduza a taxa básica americana, evitando um impacto maior na atividade.”

DESEMPREGO



“A pesquisa Pnad divulgada no final de fevereiro indicou que a taxa de desemprego mantém sua tendência de queda. A taxa de desemprego no trimestre findo em janeiro ficou em 11,2%, contra 12% no mesmo período de 2019. Nos últimos doze meses, a estimativa do IBGE é de que cerca de 1,9 milhões de pessoas foram empregadas no Brasil, o que tem um impacto de cerca de 2,2% de

C B H S J

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

crescimento na massa salarial. A melhora no emprego e renda juntamente com o cenário de juros baixos deve continuar impulsionando o crescimento do consumo doméstico, mantendo a atividade econômica mais aquecida.”

ÍNDICE DE COMMODITIES GLOBAL



Fonte: Bloomberg, Banco Inter

“A redução dos preços das commodities no mercado internacional tem sido um dos impactos da desaceleração global visto até o momento. Apesar do efeito da contenção da epidemia na China ter um impacto na oferta, reduzindo significativamente a produção industrial como observado em fevereiro, a redução na demanda por matérias primas como petróleo e metais foi ainda mais significativa, causando uma forte queda nas commodities, cerca de 15% desde o começo do ano. Acreditamos que essa desaceleração possa continuar nos próximos meses, com o impacto da epidemia em outros países, mas estímulos monetários e fiscais por parte dos governos devem ajudar na recuperação já no segundo semestre de 2020.”

e

[Assinatura]
6

Relatório de Investimentos – Fevereiro/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 (%)				
	31/01/2019	28/02/2019	dez/19	jan/20	fev/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 951.811.398,87	R\$ 956.151.580,68	0,9588	0,4858	0,4559	1,9118%	0,9440%	NC
BB PREVID TP VII	R\$ 19.869.083,18	R\$ 19.428.475,61	0,9171	0,1966	0,4125	1,5326%	0,6099%	9,0930%
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 198.751.146,37	R\$ 198.745.964,32	0,3700	0,3700	0,2484	0,9916%	0,6193%	5,4149%
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 61.279.592,00	R\$ 61.518.600,63	0,8500	0,4288	0,3885	1,6760%	0,8190%	NC
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 75.029.425,42	R\$ 75.520.466,69	1,2300	0,5581	0,6502	2,4569%	1,2119%	11,9660%
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 2.177.557,56	R\$ 14.449,78	0,3500	0,3514	0,2634	0,9679%	0,6158%	4,8569%
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF	R\$ 44.868.865,68	R\$ 43.778.431,26	0,7800	(0,0358)	0,2500	0,9958%	0,2141%	7,1547%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 53.144.822,25	R\$ 52.264.254,55	1,4900	0,7992	0,7000	3,0172%	1,5048%	16,0515%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 621.561.444,03	R\$ 625.474.431,84	1,2061	0,5441	0,6295	2,3973%	1,1770%	11,8719%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 396.966.681,83	R\$ 399.416.352,21	0,5934	0,8193	0,6170	2,0433%	1,4414%	14,2278%
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 12.893.149,56	R\$ 12.968.113,77	1,1600	0,9492	0,5814	2,7140%	1,5361%	NC
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 54.414.287,42	R\$ 54.751.029,81	1,2300	0,5700	0,6188	2,4371%	1,1924%	NC
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 111.209.977,41	R\$ 111.525.755,34	2,6000	0,0205	0,2839	2,9125%	0,3045%	NC
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 234.822.926,47	R\$ 235.427.895,15	0,3400	0,3408	0,2576	0,9413%	0,5993%	9,5991%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 65.403.254,72	R\$ 65.826.850,40	2,2400	0,3519	0,6477	3,2643%	1,0019%	NC
SANTANDER RF ATIVO FIC	R\$ 92.510.317,31	R\$ 92.756.359,83	0,4033	0,3418	0,2660	1,0144%	0,6086%	1,0144%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 2.996.713.930,08	R\$ 3.005.569.011,87						

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)				
	31/01/2019	28/02/2019	dez/19	jan/20	fev/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 97.686.134,27	R\$ 88.930.793,25	6,5217	(1,4392)	(8,9627)	-4,4212%	-10,2729%	NC
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 83.954.695,82	R\$ 122.375.745,58	10,4300	1,6141	(7,9100)	3,3365%	-6,4236%	NC
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPH	R\$ 33.087.522,09	R\$ 30.376.183,29	7,4000	(0,2553)	(8,1944)	-1,6525%	-8,4288%	NC
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 222.360.991,89	R\$ 206.508.810,30	7,1900	2,0318	(7,1290)	1,5710%	-5,2421%	24,9072%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 99.002.501,64	R\$ 89.054.444,61	8,2221	3,3830	(10,0483)	0,6409%	-7,0052%	39,7534%
ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FI	R\$ 26.280.760,34	R\$ 24.074.425,41	7,2800	(1,5472)	(8,3952)	-3,2469%	-9,8125%	NC
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 272.194.807,54	R\$ 253.138.164,67	7,5100	0,6210	(7,0011)	0,6040%	-6,4236%	21,2035%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 180.758.123,74	R\$ 163.057.361,70	8,1300	(0,1889)	(9,7925)	-2,6429%	-9,9629%	NC
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 10.512.308,42	R\$ 9.694.881,74	8,2700	0,6759	(7,7759)	0,5259%	-7,1526%	15,9724%
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 164.487.751,26	R\$ 149.246.152,85	10,2100	1,4671	(9,2661)	1,4649%	-7,9350%	20,6901%
ITAÚ SMALL CAPS VALUATION	R\$ 57.227.707,88	R\$ 52.473.264,14	-	(4,6205)	(8,3079)	-12,5446%	-12,5446%	NC
SAFRA S&P REAIS	R\$ 19.313.414,95	R\$ 17.875.827,94	2,6300	0,3716	(7,4435)	-4,6563%	-7,0996%	10,2388%
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 76.728.076,02	R\$ 69.670.071,08	7,8126	(0,6598)	(9,1877)	-2,7390%	-9,7869%	12,2933%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 109.399.964,55	R\$ 99.578.296,98	7,6335	(0,4094)	(8,9778)	-2,4307%	-9,3504%	NC
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$ 51.644.933,73	R\$ 46.892.818,40	-	(2,5108)	(9,2015)	-11,4813%	-11,4813%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.504.639.694,13	R\$ 1.422.947.241,94						
TOTAL GERAL	R\$ 4.501.353.624,21	R\$ 4.428.516.253,81						

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 no período.

Nota 2: Os Recursos de Contribuição Previdenciária recebidos no período foram direcionados para o fundo Bradesco FIA MID SMALL CAPS, conforma autorização com base na ATA COMIV 159/2020;

Nota 3: Conforme registrado no Cenário, os mercados internacionais e no Brasil apresentaram alta volatilidade no mês de fevereiro, com quedas significativas nas bolsas e uma fuga geral para ativos de menor risco, como títulos de governo. Esse movimento de realização foi causado pelas incertezas em relação ao impacto do Corona Vírus, que nas últimas semanas se espalhou além da China para Itália, Coreia do Sul e

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

Japão, países importantes na cadeia de produção global, o que pode gerar um impacto maior na desaceleração da atividade econômica. Os resultados observados nas aplicações refletem claramente o Cenário, com maior valorização dos fundos indexados à inflação (IMA) e desvalorização acentuada nos fundos de Ações.

Nota 4: Considerando a visão de longo prazo para os investimentos dos RPPS, além das expectativas de recuperação do mercado com o fim da crise pelo Corona Vírus, os recursos em Renda Variável devem ser mantidos, pois a desvalorização das cotas não representa perdas financeiras, e estas só acontecem quando é desfeita uma aplicação pelo valor inferior ao que foi adquirido.

2.2 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXECUTIVO

INSTITUIÇÃO	dez/19	jan/20	fev/20
BRDESCO	RS 424.042.829,70	RS 454.279.939,27	RS 488.551.410,29
BANCO DO BRASIL	RS 1.144.070.428,43	RS 1.069.366.616,33	RS 1.064.510.849,54
CAIXA	RS 1.288.543.786,72	RS 1.215.544.315,43	RS 1.209.987.914,47
ITAÚ	RS 646.466.762,57	RS 648.287.136,78	RS 609.899.555,58
SANTANDER	RS 334.162.744,81	RS 330.283.291,60	RS 308.897.546,29
ICATU/BEM DTVM	RS 475.273.633,43	RS 476.992.982,29	RS 456.457.489,00
SAFRA	RS 84.415.801,77	RS 84.716.669,65	RS 83.702.678,34
BTG PACTUAL	RS 67.233.626,38	RS 222.360.991,89	RS 206.508.810,30
TOTAL	RS 4.464.209.613,81	RS 4.501.831.943,24	RS 4.428.516.253,81

Quadro 2.

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA FPREV EXEC -
FEVEREIRO - 2020

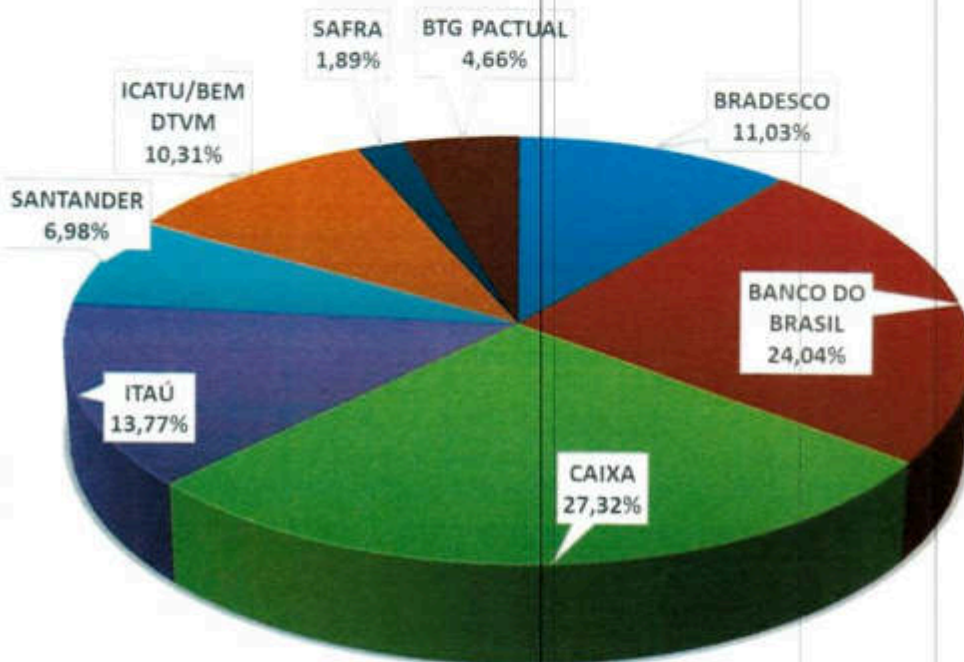


Gráfico 1

8

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

2.3 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA

FUNDO DE INVESTIMENTO	ÍNDICE DE REFERÊNCIA	SALDO APLICADO	% APLICADO
BRADESCO FI REFER DI PREMIUM BRADESCO FI MAXI PODER PUBLICO	CDI	R\$ 198.760.414,10	4,49%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATEGICA BB PREVID ALOCAÇÃO ATIVA SAFRA CONSUMO AMERICANO SAFRA S&P REAIS BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA ITAU INST. ALOC. DINÂMICA FI SANTANDER RF ATIVO FIC	CDI ATIVO	R\$ 1.763.146.616,44	39,81%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF SANTANDER IMA B INST. TP	IMA B	R\$ 65.826.850,40	1,49%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5 CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP ICATU VANG. FI RF INFLA. CP ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	IMA B 5	R\$ 768.714.042,11	17,36%
BB PREVID IDKA 2 TP RF	IDKA 2	R\$ -	0,00%
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF BB PREVID RF IMA B5+	IMA B 5+	R\$ 111.525.755,34	2,52%
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF BB PREVID TP VII BB PREVID TP IX	IPCA + 6%	R\$ 115.471.161,42	2,61%
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FI BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	IBR X	R\$ 54.450.608,70	1,23%
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS ITAU SMALL CAPS VALUATION CAIXA CONSUMO FI AÇÕES ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ITAU INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES BTG ABSOLUTO FIQ FIA SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES SANTANDER SELEÇÃO 30	IBOVESPA	R\$ 1.350.620.805,30	30,50%
TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO		R\$ 4.428.516.253,81	100%

Quadro 3.

DISTRIBUIÇÃO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA - AMAZONPREV

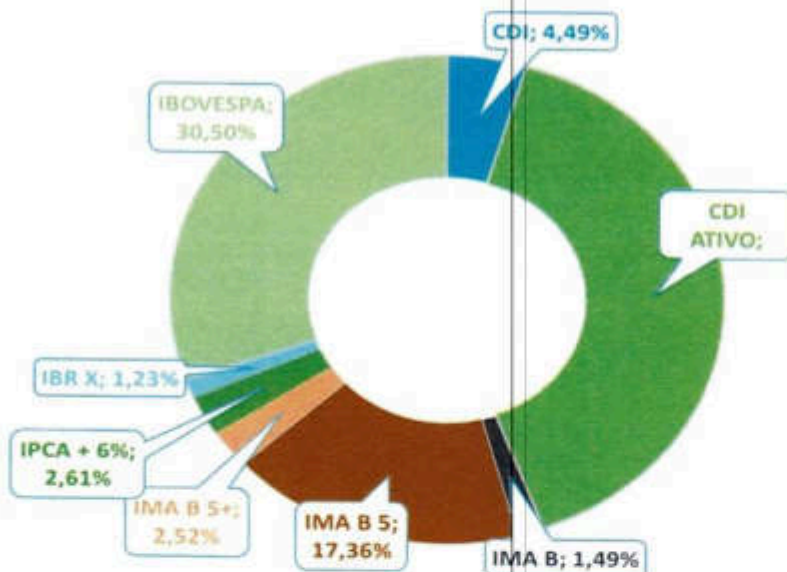


Gráfico 2.


 9

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/01/2020	28/02/2020	dez/19	jan/20	fev/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 153.621.680,85	R\$ 154.813.643,15	1,6806	0,7357	0,7759	3,223%	1,5173%	10,7444%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 159.751.181,43	R\$ 156.764.372,12	1,6902	0,7451	0,7854	3,252%	1,5363%	10,8690%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 163.125.069,49	R\$ 160.138.570,47	1,7140	0,7687	0,8090	3,325%	1,5839%	11,1813%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 165.498.874,34	R\$ 162.469.376,23	1,6902	0,7452	0,7854	3,253%	1,5364%	10,8693%
TOTAL GERAL	R\$ 641.996.806,11	R\$ 634.185.961,98						

Quadro 4.

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

Nota 2: No mês de fevereiro/2020, as NTN Bs, com vencimento em 15 de agosto, pagaram cupom de juros no montante de R\$ 12.934.711,91, de forma que reduziu o volume de recursos aplicados nesses ativos.

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\$ 153.621.680,85	R\$ 159.751.181,43	R\$ 163.125.069,49	R\$ 165.498.874,34
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	
	31/01/2020	28/02/2020
CVS - A	R\$ 1.449.439,30	R\$ 1.431.985,98
CVS - B	R\$ 9.378.758,30	R\$ 9.265.780,50
CVS - C	R\$ 188.024,20	R\$ 185.760,12
CVS - D	R\$ 1.028.505,72	R\$ 1.016.116,20
TOTAL	R\$ 12.044.727,52	R\$ 11.899.642,80

Quadro 6.

Nota: Os Títulos CVS realizam amortização mensal de juros pagamento de parte do principal, a ocorrer até o vencimento em 01/01/2027, motivo da redução dos valores aplicados.

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
TOTAL	R\$ 70.153,56	R\$ 290.169,44	R\$ 360.323,00

Quadro 7.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

2.9 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2020 (Contrato Regular)					
MÊS	UEA		SEAS		TOTAL
jan/20					R\$ -
fev/20					R\$ -
mar/20	R\$	58.180,96	R\$	301.093,20	R\$ 359.274,16
TOTAL	R\$	58.180,96	R\$	301.093,20	R\$ 359.274,16

Quadro 8.

2.10 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	31/01/2020	28/02/2020	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.501.353.624,21	R\$ 4.428.516.253,81	86,0269%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 641.996.806,11	R\$ 634.185.961,98	12,3195%
TÍTULOS CVS	R\$ 12.044.727,52	R\$ 11.899.642,80	0,2312%
IMÓVEIS	R\$ 60.353.005,55	R\$ 60.353.005,55	1,1724%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 5.790,46	R\$ 12.873.479,97	0,2501%
TOTAL	R\$ 5.215.753.953,85	R\$ 5.147.828.344,11	100,0000%

Quadro 9.

2.11 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS – FPREV EXECUTIVO

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
fev/19	R\$ 4.198.622.173,30	1,30%	3,61%	20,77%
mar/19	R\$ 4.270.610.204,33	1,71%	5,39%	20,79%
abr/19	R\$ 4.340.813.251,38	1,64%	7,12%	21,39%
mai/19	R\$ 4.441.433.234,67	2,32%	9,60%	24,70%
jun/19	R\$ 4.560.478.660,06	2,68%	12,54%	26,72%
jul/19	R\$ 4.650.607.110,06	1,98%	14,77%	25,75%
ago/19	R\$ 4.698.765.985,21	1,04%	15,96%	25,85%
set/19	R\$ 4.814.401.867,02	2,46%	18,81%	26,83%
out/19	R\$ 4.927.631.461,93	2,35%	21,60%	26,59%
nov/19	R\$ 4.968.291.263,50	0,83%	22,61%	26,14%
dez/19	R\$ 5.173.977.182,42	4,14%	27,68%	27,68%
jan/20	R\$ 5.215.753.953,85	0,81%	0,81%	24,54%
fev/20	R\$ 5.147.828.344,11	-1,30%	-0,51%	20,89%

Quadro 10.

11

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

2.12 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Município de Governo Amazonas / AM - EXECUTIVO2020

16/01/2020 14:33:02

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 28/02/2020	
Mês/Ano	Saldo Financeiro em 28/02/2019	Saldo Financeiro em 28/02/2020	
	4.198.622.173,30	5.147.828.344,11	
	Receitas RS	Despesas RS	Resultado RS
03/2019	48.780.707,02	1.653.421,67	47.127.285,35
04/2019	27.254.847,98	1.484.969,43	25.769.878,55
05/2019	37.682.513,87	1.872.658,21	35.809.855,66
06/2019	41.150.382,45	1.842.441,88	39.307.940,57
07/2019	38.725.793,39	2.036.530,69	36.689.262,70
08/2019	39.885.991,44	1.920.723,93	37.965.267,51
09/2019	41.301.229,85	1.811.278,88	39.489.950,97
10/2019	40.858.104,23	2.023.186,58	38.834.917,65
11/2019	40.805.162,75	889.103,33	39.916.059,42
12/2019	80.878.067,28	1.824.810,55	79.053.256,73
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
	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	4,0049 %	0,4605 %	0,2500 %
Juros	5,8800 %	0,9568 %	0,4773 %
Meta	10,1204 %	1,4217 %	0,7285 %
Rentabilidade %	10,3311 %	-1,9276 %	-2,1588 %
Rentabilidade RS	-455.372.613,12	-100.018.720,89	-112.598.187,92
Resultado %	+0,1913 %	-3,3024 %	-2,8664 %
Resultado RS	+9.276.682,85	-173.786.552,83	-150.593.047,93

Quadro 11.

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO- FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS						VALORIZAÇÃO		
	31/01/2020	28/02/2020	dez/19	jan/20	fev/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 243.401,22	R\$ 218.943,56	-	(2,6195)	(10,0483)	-12,4226%	-12,4226%	NC	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 4.560.457,17	R\$ 4.588.599,64	0,5934	0,8193	0,6170	2,0433%	1,4414%	14,2278%	
ITAU INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 4.637.823,36	R\$ 4.649.771,65	0,3400	0,3408	0,2576	0,9413%	0,5993%	NC	
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 600.610,65	R\$ 558.561,27	7,5100	0,6210	(7,0011)	0,6040%	-6,4256%	NC	
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 469.695,56	R\$ 472.426,50	1,1600	0,9492	0,5814	2,7140%	1,5361%	NC	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 116.166,02							
TOTAL	R\$ 10.511.987,97	R\$ 10.604.468,64							

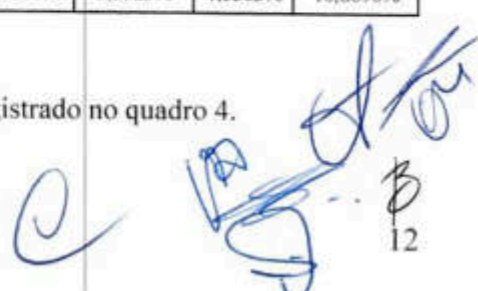
Quadro 12.

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO			VALORIZAÇÃO (%)				
	30/01/2020	28/02/2020	dez/19	jan/20	fev/20	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.181.482,63	R\$ 2.140.728,62	1,690157	0,745138	0,785351	3,2525%	1,5363%	10,8690%
TOTAL GERAL	R\$ 2.181.482,63	R\$ 2.140.728,62						

Quadro 13.

Nota: Recebido pagamento de cupom de juros de NTN B, conforme registrado no quadro 4.


 12

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

3.3 Composição dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS - ALE FPREV	dez/19	jan/20	fev/20
SALDO ANTERIOR	12.150.767,48	12.391.075,09	12.693.470,59
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	116.605,44	232.286,40	116.166,02
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	123.702,17	70.109,10	(64.439,35)
SAIDAS FINANCEIRAS	-	-	-
SALDO FINAL	12.391.075,09	12.693.470,59	12.745.197,26

Quadro 14

3.4 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	31/01/2020	28/02/2020
FUNDOS DE INVESTIMENTO	RS 10.511.987,97	RS 10.488.302,62
TÍTULOS PÚBLICOS	RS 2.181.482,63	RS 2.140.728,62
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	RS -	RS 116.166,02
TOTAL	RS 12.693.470,60	RS 12.745.197,26

Quadro 15.

3.5 Evolução dos Recursos – ALE/FPREV

Mês	Recursos ALE FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
fev/19	RS 10.201.534,98	1,64%	5,71%	28,95%
mar/19	RS 10.372.018,29	1,67%	7,48%	28,87%
abr/19	RS 11.181.920,91	7,81%	15,87%	35,97%
mai/19	RS 10.907.257,42	-2,46%	13,02%	33,82%
jun/19	RS 11.207.199,38	2,75%	16,13%	35,83%
jul/19	RS 11.373.542,16	1,48%	17,85%	33,46%
ago/19	RS 11.456.007,59	0,73%	18,71%	32,37%
set/19	RS 11.774.465,04	2,78%	22,01%	30,94%
out/19	RS 12.017.646,25	2,07%	24,53%	33,35%
nov/19	RS 12.150.767,48	1,11%	25,91%	32,09%
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%

Quadro 16.


 13

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

3.6 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Município de Governo Amazonas / AM - ASSEMBLEIA 2020

16/03/2020 13:56:29

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 28/02/2020	
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
		Saldo Financeiro em 28/02/2019	10.201.534,98
03/2019	108.995,35	0,00	108.995,35
04/2019	118.011,62	0,00	118.011,62
05/2019	115.170,24	0,00	115.170,24
06/2019	114.154,91	0,00	114.154,91
07/2019	0,00	0,00	0,00
08/2019	116.326,93	0,00	116.326,93
09/2019	115.124,97	0,00	115.124,97
10/2019	117.675,84	0,00	117.675,84
11/2019	116.604,44	0,00	116.604,44
12/2019	116.912,84	0,00	116.912,84
01/2020	232.286,40	0,00	232.286,40
02/2020	116.166,02	0,00	116.166,02
		Saldo Financeiro em 28/02/2020	12.745.197,26

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	4,0049 %	0,4605 %	0,2500 %
Juros	5,8800 %	0,9568 %	0,4773 %
Meta	10,1204 %	1,4217 %	0,7285 %
Rentabilidade %	10,7408 %	0,0453 %	-0,5077 %
Rentabilidade R\$	1.156.232,72	5.669,75	-64.439,36
Resultado %	+0,5633 %	-1,3571 %	-1,2272 %
Resultado R\$	+66.721,65	-172.145,77	-156.906,65

Quadro 17.

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)					
	31/01/2020	28/02/2020		dez19	jan20	fev20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 50.749.468,54	R\$ 52.412.003,00		0,8500	0,4288	0,3885	1,6760%	0,8190%	NC
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+	R\$ 13.030.298,77	R\$ -		2,7212	0,0474	-	2,7699%	0,4326%	NC
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 81.912.874,73	R\$ -		1,1526	0,3850	-	1,5420%	1,2309%	NC
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ -	R\$ 95.027.638,94		1,1526	0,3850	0,4559	2,0050%	0,8426%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 320.493,67							
TOTAL	R\$ 145.692.642,04	R\$ 147.760.135,61							

Quadro 18.

(Handwritten signatures and initials)

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Município de Governo Amazonas / AM - PGJMP2020

16/03/2020 14:36:38

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 28/02/2020	
		Saldo Financeiro em 28/02/2019	100.366.428,07
Mês/Ano	Receitas RS	Despesas RS	Resultado RS
03/2019	0,00	0,00	0,00
04/2019	0,00	0,00	0,00
05/2019	0,00	0,00	0,00
06/2019	10.130.614,70	0,00	10.130.614,70
07/2019	4.683.054,25	14.095,87	4.668.958,38
08/2019	4.661.168,61	0,00	4.661.168,61
09/2019	6.692.727,22	0,00	6.692.727,22
10/2019	3.644.592,21	17.678,19	3.626.914,02
11/2019	1.219.736,18	15.030,00	1.204.706,18
12/2019	1.375.656,88	0,00	1.375.656,88
01/2020	2.720.435,75	16.316,13	2.704.119,62
02/2020	1.490.511,62	15.618,19	1.474.893,43
		Saldo Financeiro em 28/02/2020	147.760.135,61

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	4,0049 %	0,4605 %	0,2500 %
Juros	5,8800 %	0,9568 %	0,4773 %
Meta	10,1204 %	1,4217 %	0,7285 %
Rentabilidade %	9,3096 %	0,7817 %	0,4067 %
Rentabilidade RS	10.853.948,50	1.124.184,51	592.600,14
Resultado %	-0,7363 %	-0,6310 %	-0,3194 %
Resultado RS	-942.520,14	-920.351,73	-468.717,47

Quadro 19.

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2019	31/01/2020	nov/19	dez/19	jan/20	TRIMESTRE	2020	ULTIMOS 12 MESES	
BRABESCO INST. FIC F1 RF IMA B5	R\$ 9.189.306,67	R\$ 9.240.593,21	(0,3896)	1,2300	0,5581	1,3984%	0,5581%	NC	
BRABESCO INST. ALOC. DINAMICA	R\$ 3.267.102,47	R\$ 3.281.112,33	(0,3291)	0,8500	0,4288	0,9492%	0,4288%	NC	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE									
TOTAL	R\$ 12.456.409,14	R\$ 12.521.705,54							

Quadro 20.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Município de Governo Amazonas / AM - DEFENSORIA2020

16/03/2020 14:29:26

Fundo Previdenciário

Cálculo Posicionado em 28/02/2020

Mês/Ano	Saldo Financeiro em 28/02/2019		Resultado RS
	Receitas RS	Despesas RS	
			3.077.433,76
03/2019	627.819,72	0,00	627.819,72
04/2019	637.839,76	0,00	637.839,76
05/2019	648.474,00	0,00	648.474,00
06/2019	664.320,93	0,00	664.320,93
07/2019	683.371,79	0,00	683.371,79
08/2019	775.936,11	0,00	775.936,11
09/2019	779.947,37	0,00	779.947,37
10/2019	784.381,09	0,00	784.381,09
11/2019	780.946,33	0,00	780.946,33
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
			13.406.924,99

Saldo Financeiro em 28/02/2020

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	4,0049 %	0,4605 %	0,2500 %
Juros	5,8800 %	0,9568 %	0,4773 %
Meta	10,1204 %	1,4217 %	0,7285 %
Rentabilidade %	9,3228 %	1,0886 %	0,5615 %
Rentabilidade RS	654.708,43	135.601,32	70.304,92
Resultado %	-0,7244 %	-0,3285 %	-0,1658 %
Resultado RS	-55.423,40	-41.497,65	-20.911,13

Quadro 21.

6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)							
	31/12/2019	31/01/2020	out19	nov19	dez19	jan20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRASESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 22.151.234,44	R\$ 21.989.827,29	1,6870	(0,3896)	1,2300	(0,5581)	1,3984%	0,5581%	NC	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 2.512.980,82								
TOTAL	R\$ 22.151.234,44	R\$ 24.502.808,11								

Quadro 22.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

6.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Município de Governo Amazonas / AM - TRIBUNALJUSTICA2020

16/03/2020 14:44:35

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 28/02/2020	
		Saldo Financeiro em 28/02/2019	0,00
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
03/2019	1.124.231,98	0,00	1.124.231,98
04/2019	1.129.159,87	0,00	1.129.159,87
05/2019	1.132.493,24	0,00	1.132.493,24
06/2019	1.138.021,63	241.430,62	896.591,01
07/2019	2.565.437,98	291.519,39	2.273.918,59
08/2019	3.884.077,90	67.916,92	3.816.160,98
09/2019	2.508.252,24	494.376,53	2.013.875,71
10/2019	2.781.927,34	277.820,43	2.504.106,91
11/2019	2.561.139,60	248.791,25	2.312.348,35
12/2019	5.065.716,87	398.911,86	4.666.805,01
01/2020	2.510.168,73	282.179,91	2.227.988,82
02/2020	2.546.041,07	248.112,69	2.297.928,38
		Saldo Financeiro em 28/02/2020	26.955.991,45

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	4,0049 %	0,4605 %	0,2500 %
Juros	5,8800 %	0,9568 %	0,4773 %
Meta	10,1204 %	1,4217 %	0,7285 %
Rentabilidade %	5,7510 %	1,1987 %	0,6336 %
Rentabilidade R\$	560.382,60	278.839,81	155.254,96
Resultado %	-3,9678 %	-0,2199 %	-0,0942 %
Resultado R\$	-416.652,28	-51.877,63	-23.239,04

Quadro 23.

7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS				VALORIZAÇÃO (%)						
	31/12/2019		31/01/2020		out/19	nov/19	dez/19	jan/20	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$	3.506.553,79	R\$	3.777.030,73	1,6870	(0,3896)	1,2300	(0,5581)	1,3984%	0,5581%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$	-	R\$	446.409,65							
TOTAL	R\$	3.506.553,79	R\$	4.223.440,38							

Quadro 24.

B
 17

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

7.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Município de Governo Amazonas / AM - TRIBUNALCONTAS2020

16/03/2020 14:40:38

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 28/02/2020	
		Saldo Financeiro em 28/02/2019	0,00
Mês/Ano	Receitas RS	Despesas RS	Resultado RS
03/2019	0,00	0,00	0,00
04/2019	0,00	0,00	0,00
05/2019	0,00	0,00	0,00
06/2019	446.815,11	0,00	446.815,11
07/2019	449.663,70	0,00	449.663,70
08/2019	456.011,93	0,00	456.011,93
09/2019	526.068,24	0,00	526.068,24
10/2019	447.922,04	0,00	447.922,04
11/2019	889.854,89	0,00	889.854,89
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
		Saldo Financeiro em 28/02/2020	4.696.470,07

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	4,0049 %	0,4605 %	0,2500 %
Juros	5,8800 %	0,9568 %	0,4773 %
Meta	10,1204 %	1,4217 %	0,7285 %
Rentabilidade %	9,1797 %	1,2343 %	0,6453 %
Rentabilidade RS	131.871,24	47.568,70	27.254,19
Resultado %	-0,8542 %	-0,1848 %	-0,0826 %
Resultado RS	-13.169,06	-7.220,00	-3.512,03

Quadro 25.

18

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

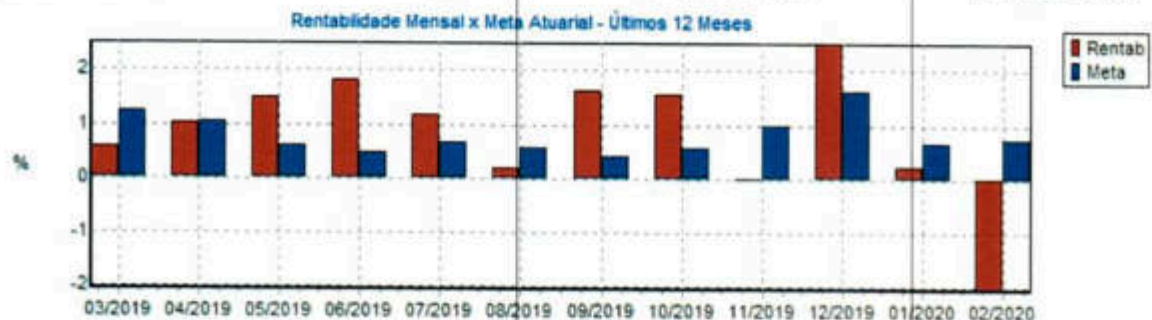
Cliente: Município de Governo Amazonas / AM - CONSOLIDADO2020

16/03/2020 14:24:52

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 28/02/2020	
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
		Saldo Financeiro em 28/02/2019	4.312.267.570,11
03/2019	50.641.754,07	1.653.421,67	48.988.332,40
04/2019	29.139.859,23	1.484.969,43	27.654.889,80
05/2019	38.446.158,11	1.872.658,21	36.573.499,90
06/2019	53.197.494,62	2.083.872,50	51.113.622,12
07/2019	47.110.321,11	2.328.050,08	44.782.271,03
08/2019	49.779.512,92	1.988.640,85	47.790.872,07
09/2019	51.923.350,05	2.305.655,41	49.617.694,64
10/2019	48.634.602,75	2.318.685,20	46.315.917,55
11/2019	46.373.444,19	1.152.924,58	45.220.519,61
12/2019	90.119.100,38	2.223.722,41	87.895.377,97
01/2020	37.410.959,00	2.352.687,68	35.058.271,32
02/2020	54.996.430,46	5.174.174,42	49.822.256,04
		Saldo Financeiro em 28/02/2020	5.353.393.063,49

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	4,0049 %	0,4605 %	0,2500 %
Juros	5,8800 %	0,9568 %	0,4773 %
Meta	10,1204 %	1,4217 %	0,7285 %
Rentabilidade %	10,3313 %	-1,8279 %	-2,0648 %
Rentabilidade R\$	470.291.968,93	-98.426.856,80	-111.817.213,06
Resultado %	+0,1915 %	-3,2041 %	-2,7731 %
Resultado R\$	+9.591.438,22	-174.979.645,60	-151.266.334,23



Quadro 26.

19

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

9. RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/01/2020	28/02/2020
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.998.151,55	R\$ 17.153.951,63
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	-	-
BRADESCO FIC FI RF ALOC. DINÂMICA - COMPREV	R\$ 4.207.956,23	R\$ 4.310.739,03
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 7.409.440,98	R\$ 4.519.312,05
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 79.595.506,82	R\$ 34.924,55
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 69.812,13	R\$ 74.576,64
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 6.458.213,21
TOTAL	R\$ 93.280.867,71	R\$ 32.551.717,11

Quadro 27.

Nota 1: Os valores recebidos de Contribuição Previdenciária no FFIN são utilizados no pagamento das folhas de aposentados e pensionistas dessa massa previdenciária.

Nota 2: Em decorrência da mudança no calendário de pagamentos de inativos e pensionistas para o início do mês subsequente, os valores de contribuição são mantidos em fundo de curto prazo e indexados ao CDI.

9.2 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/01/2020	28/02/2020
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 458.457,08	R\$ 691.424,82
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 458.457,08	R\$ 691.424,82

Quadro 28.

9.3 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/01/2020	28/02/2020
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 310.902,41	R\$ 441.964,73
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 511.918,74	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 822.821,15	R\$ 441.964,73

Quadro 29.

9.4 Composição do Recursos – ALE FFIN

DESCRIÇÃO	dez/19	jan/20	fev/20
SALDO ANTERIOR	R\$ 377.518,95	R\$ 208.720,44	R\$ 822.821,15
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	R\$ 1.157.020,68	R\$ 1.663.105,76	R\$ 892.875,48
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ 2.720.427,93	R\$ 706.868,30	R\$ 966.611,31
VARIAÇÃO FINANCEIRA	R\$ 1.546,01	R\$ 10.791,43	-R\$ 8.410,53
(-) SAIDAS FINANCEIRAS	-R\$ 4.047.793,13	-R\$ 1.766.664,78	-R\$ 2.231.932,68
SALDO FINAL	R\$ 208.720,44	R\$ 822.821,15	R\$ 441.964,73

Quadro 30.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/01/2020	28/02/2020
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 381.385,15	R\$ 774.087,77
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ -	R\$ 189.118,29
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ -
TOTAL	R\$ 381.386,15	R\$ 963.206,06

Quadro 31.

10. TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS				VALORIZAÇÃO (%)				
	31/01/2020	28/02/2020	nov/19	dez/19	jan/20	fev/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 5.393.335,41	R\$ 7.067.736,81	0,3562	0,3500	0,3514	0,2641	0,9686%	0,6164%	5,5098%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 37.083.234,12	R\$ 37.312.073,73	(0,5077)	0,5034	0,8193	0,6170	2,0433%	1,4414%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00							
TOTAL	R\$ 42.476.570,53	R\$ 44.379.811,54							

Quadro 32.

Nota: Utilizados os recursos do fundo Caixa FIC Brasil Gestão estratégica para pagamentos de despesas com custeio administrativo, registrado através do Ofício nº. 5.639/2019.

10.2 Taxa de Administração - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS				VALORIZAÇÃO (%)				
	31/01/2020	28/02/2020	nov/19	dez/19	jan/20	fev/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 876.485,48	R\$ 878.800,66	0,3562	0,3500	0,3514	0,2641	0,9686%	0,6164%	5,5097%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 65.782,15							
TOTAL	R\$ 876.485,48	R\$ 878.800,66							

Quadro 33.

10.3 Taxa de Administração - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS				VALORIZAÇÃO (%)				
	31/01/2020	28/02/2020	nov/19	dez/19	jan/20	fev/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 329.896,83	R\$ 380.400,14	0,3562	0,3500	0,3514	0,2641	0,9686%	0,6164%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	-	-							
TOTAL	R\$ 329.896,83	R\$ 380.400,14							

Quadro 34.

10.3 Taxa de Administração – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS				VALORIZAÇÃO (%)			
	31/01/2020	28/02/2020	dez/19	jan/20	fev/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.090.997,15	R\$ 1.248.446,40	-	0,3514	0,2641	0,3514%	0,3514%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	-	R\$ 144.126,44						
TOTAL	R\$ 1.090.997,15	R\$ 1.392.572,84						

Quadro 35.



 21

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

11. OUTROS RECURSOS

11.1 Tribunal de Justiça do Estado - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/01/2020	28/02/2020	dez/19	jan/20	fev/20	TRIMESTRE	2019	ULTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 13.622.192,29	R\$ 8.450.009,37	-	0,3514	0,2641	0,6164%	0,6164%	0,6164%
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TJA	R\$ 186.845.753,37	R\$ 187.524.477,33	0,4024	0,4226	0,3632	1,1929%	0,7873%	6,3086%
BB PREV. RF IRF MI - TJA	R\$ 182.748.838,08	R\$ 133.341.288,75	0,3973	0,4194	0,3529	1,1742%	0,7738%	6,2361%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ -	R\$ 49.761.470,31	-	-	0,4559	0,4559%	0,4559%	0,4559%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 1.318.043,50						
TOTAL	R\$ 383.216.783,74	R\$ 380.395.289,26						

Quadro 36.

11.2 Composição dos Saldos - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	dez/19	jan/20	fev/20
SALDO ANTERIOR	390.517.920,47	387.059.195,52	383.216.783,74
CONTRIB. PREVIDENCIÁRIA	11.059.829,84	5.482.791,26	4.143.825,70
VARIAÇÃO FINANCEIRA	1.541.918,38	1.606.690,82	2.225.733,81
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(16.060.473,17)	(10.931.893,86)	(9.191.053,99)
SALDO FINAL	R\$ 387.059.195,52	R\$ 383.216.783,74	R\$ 380.395.289,26

Quadro 37.

Nota: Os Repasses e as Saídas Financeiras são representados pelos créditos recebidos e pagamento dos pensionistas desses órgãos, ambos registrados sob regime de Caixa. Para pagamento das folhas de aposentados e pensionistas está sendo utilizado o recurso já repassado anteriormente, não havendo repasse de cobertura de débito nesse momento.

11.3 Tribunal de Contas do Estado - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/01/2020	28/02/2020	dez/19	jan/20	fev/20	TRIMESTRE	2019	ULTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 3.275.123,84	R\$ 4.201.451,69	-	0,3514	0,2641	0,6164%	0,6164%	0,6164%
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TCE	R\$ 73.469.646,69	R\$ 73.736.527,86	0,4024	0,4226	0,3632	1,1929%	0,7873%	6,3086%
BB PREV. RF IRF MI - TCE	R\$ 66.718.348,39	R\$ 11.896.025,71	0,3973	0,4194	0,3529	1,1742%	0,7738%	6,2361%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ -	R\$ 49.761.470,31	-	-	0,4559	0,4559%	0,4559%	0,4559%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 4.292,84	R\$ 978.717,74						
TOTAL	R\$ 143.467.411,76	R\$ 140.574.193,31						

Quadro 38.

Nota: Os Repasses e as Saídas Financeiras são representados pelos créditos recebidos e pagamento dos pensionistas desses órgãos, ambos registrados sob regime de Caixa. Para pagamento das folhas de aposentados e pensionistas está sendo utilizado o recurso já repassado anteriormente, não havendo repasse de cobertura de débito nesse momento.

11.4 Composição dos Saldos - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	dez/19	jan/20	fev/20
SALDO ANTERIOR	152.538.769,82	145.264.003,16	143.467.411,76
CONTRIB. PREVIDENCIÁRIA	1.281.462,77	3.086.168,68	1.755.172,32
VARIAÇÃO FINANCEIRA	1.525.783,91	608.208,15	1.358,25
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(10.082.013,34)	(5.490.968,23)	(4.649.749,02)
SALDO FINAL	R\$ 145.264.003,16	R\$ 143.467.411,76	R\$ 140.574.193,31

Quadro 39.

Nota: Os Repasses e as Saídas Financeiras são representados pelos créditos recebidos e pagamento dos pensionistas desses órgãos, ambos registrados sob regime de Caixa.



 B
 22

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

12. ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS

12.1 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	RS 636.326.690,60	10,87%	10%	100%	art. 7º, inciso I, "a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM I FIC FI	RS 145.237.314,46	23,56%	10%	100%	art. 7º, inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	RS 19.428.475,61				
CAIXA FI BRASIL IRF M I TP RF	RS 261.261.005,19				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	RS 625.474.431,84				
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	RS 43.778.431,26				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	RS 52.264.254,55				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	RS 54.751.029,81				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	RS 111.525.755,34				
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	RS 65.826.850,40				
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	RS 41.302.723,80	41,03%	30%	40%	art. 7º, inciso IV, "a"
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	RS 198.745.964,32				
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	RS 113.433.652,14				
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	RS 123.748.435,41				
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	RS 1.150.702.160,24				
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	RS 240.077.666,80				
SANTANDER RF ATIVO FIC FI	RS 92.756.359,83				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	RS 441.317.025,58				
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	RS 13.440.540,27				
TOTAL RENDA FIXA	RS 4.431.398.767,45	75,68%			

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	RS 30.376.183,29	0,93%	10%	30%	art. 8º, inciso I, "a"
ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI	RS 24.074.425,41				
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	RS 9.694.881,74	23,08%	30%	30%	art. 8º, inciso II, "a"
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	RS 122.375.745,58				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	RS 88.930.793,25				
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	RS 89.273.388,17				
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	RS 149.246.152,85				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	RS 163.057.361,70				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	RS 52.473.264,14				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	RS 253.696.725,94				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	RS 206.508.810,30				
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	RS 99.578.296,98				
SANTANDER SELEÇÃO 30	RS 46.892.818,40				
SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES	RS 69.670.071,08				
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	RS 17.875.827,94				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	RS 1.423.724.746,77	24,32%			

TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	RS 5.855.123.514,22	100,00%
-----------------------------------	----------------------------	----------------

Quadro 40.

Nota: Registra-se Desenquadramento ao art. 7º, IV-a, cujo limite de 40% estabelecido pela Resolução CMN nº. 3.922/2010 foi superado em 1,03% com alocações nos fundos Bradesco Maxi Poder Público e BB Previdenciário Alocação Ativa. Regularizado em Março/2020.

23

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% CARTEIRA	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM I FIC FI	R\$ 145.237.314,46	2,44%	20%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 19.428.475,61	0,33%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ -	0,00%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ -	0,00%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 1.150.702.160,24	19,32%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 88.930.793,25	1,49%	
CAIXA FI BRASIL IRF M I TP RF	R\$ 261.261.005,19	4,39%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 625.474.431,84	10,50%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 43.778.431,26	0,74%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 52.264.254,55	0,88%	
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 41.302.723,80	0,69%	
BRDESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 198.745.964,32	3,34%	
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 113.433.652,14	1,90%	
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 123.748.435,41	2,08%	
BRDESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 30.376.183,29	0,51%	
BRDESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 122.375.745,58	2,05%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 240.077.666,80	4,03%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 441.317.025,58	7,41%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 9.694.881,74	0,16%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 163.057.361,70	2,74%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 52.473.264,14	0,88%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 89.273.388,17	1,50%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 149.246.152,85	2,51%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 253.696.725,94	4,26%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 13.440.540,27	0,23%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 54.751.029,81	0,92%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 111.525.755,34	1,87%	
ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI	R\$ 24.074.425,41	0,40%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 206.508.810,30	3,47%	
SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 69.670.071,08	1,17%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 99.578.296,98	1,67%	
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$ 46.892.818,40	0,79%	
SANTANDER RF ATIVO FIC FI	R\$ 92.756.359,83	1,56%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 17.875.827,94	0,30%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 65.826.850,40	1,11%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO	R\$ 5.218.796.823,62		

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.

@


 24

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

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

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - RS	% DO PL DO FUNDO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM I FIC F1	RS 145.237.314,46	7.492.585.716,79	1,94%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	RS 19.428.475,61	676.748.275,25	2,87%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	RS -	2.259.425.476,17	0,00%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	RS -	6.830.764.502,36	0,00%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	RS 1.150.702.160,24	10.908.803.618,87	10,55%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	RS 88.930.793,25	798.991.874,74	11,13%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	RS 41.302.723,80	382.730.467,18	10,79%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	RS 198.745.964,32	4.898.267.943,34	4,06%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	RS 113.433.652,14	851.386.042,42	13,32%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	RS 123.748.435,41	1.234.231.884,13	10,03%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	RS 30.376.183,29	224.637.830,02	13,52%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	RS 122.375.745,58	2.352.724.363,15	5,20%	
CAIXA FI BRASIL IRF M I TP RF	RS 261.261.005,19	10.513.960.188,40	2,48%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	RS 625.474.431,84	9.698.235.388,71	6,45%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	RS 43.778.431,26	256.322.456,81	17,08%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	RS 52.264.254,55	213.289.312,56	24,50%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	RS 441.317.025,58	10.626.779.468,55	4,15%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	RS 89.273.388,17	903.356.588,09	9,88%	
ITAU INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	RS 240.077.666,80	5.092.614.949,01	4,71%	
ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	RS 9.694.881,74	830.830.920,01	1,17%	
ITAU INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	RS 149.246.152,85	2.262.526.519,52	6,60%	
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC	RS 163.057.361,70	4.106.559.997,95	3,97%	
ITAU SMALL CAP VALUATION	RS 52.473.264,14	1.830.832.341,56	2,87%	
SANTANDER SELEÇÃO 30	RS 46.892.818,40	1.870.873.876,15	2,51%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	RS 69.670.071,08	689.674.752,99	10,10%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	RS 99.578.296,98	893.485.595,74	11,14%	
SANTANDER RF ATIVO FIC FI	RS 92.756.359,83	889.776.360,07	10,42%	
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	RS 253.696.725,94	1.963.717.198,95	12,92%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	RS 54.751.029,81	519.747.005,99	10,53%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	RS 111.525.755,34	1.187.095.300,64	9,39%	
ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FI	RS 24.074.425,41	219.173.266,29	10,98%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	RS 65.826.850,40	1.658.382.741,96	3,97%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	RS 206.508.810,30	1.938.091.271,83	10,66%	
TOTAL	RS 5.187.480.455,41			

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14, § 1º	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - RS	% DO PL	Resolução CMN nº 3.922/2010
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	RS 17.875.827,94	393.099.384,46	4,55%	5%
ICATU VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	RS 13.440.540,27	535.880.895,76	2,51%	
TOTAL	RS 31.316.368,21			

TOTAL RS 5.218.796.823,62

Quadro 42.

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

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


 25

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

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 os fundos Caixa FI Brasil 2020 V TP RF e Caixa FI Brasil 2024 VI TP RF encontram-se enquadrados, pois o resgate dessas aplicações ocorrerá no vencimento dos TPF que compõe a carteira dos fundos, ou seja, 16/08/2020 e 16/08/2024, respectivamente.

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA JAN/2020) EM R\$ MI	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (FEVEREIRO/2020)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB DTVM S.A	R\$ 1.057.361,60	R\$ 1.404.298.743,56	0,1328%	5%
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 774.075,82	R\$ 614.549.327,23	0,0794%	
BRADESCO	R\$ 557.454,47	R\$ 629.982.704,54	0,1130%	
CAIXA	R\$ 380.049,61	R\$ 1.513.368.536,59	0,3982%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	R\$ 292.507,97	R\$ 308.897.546,29	0,1056%	
BANCO BTG	R\$ 116.298,16	R\$ 206.508.810,30	0,1776%	
BANCO SAFRA	R\$ 102.095,94	R\$ 83.702.678,34	0,0820%	
ICATÚ VANGUARDA DTVM S/A	R\$ 24.853,59	R\$ 457.488.476,77	1,8407%	

Quadro 44

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

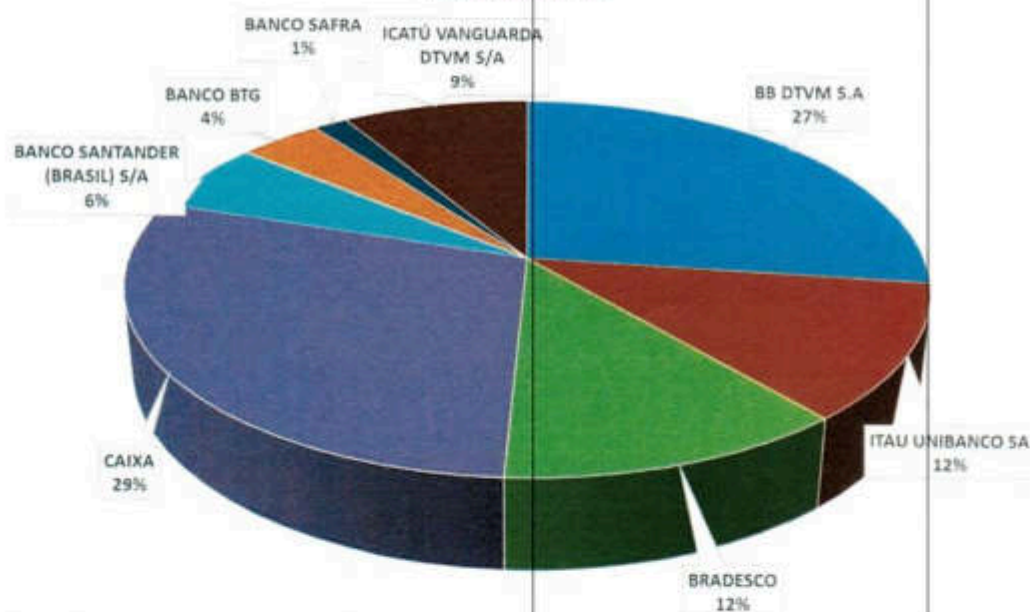


Gráfico 4.


 26

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

13. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS - AMAZONPREV

FPREV PODER EXECUTIVO	SALDO
FUNDO DE INVESTIMENTO FPREV - EXECUTIVO	R\$ 4.428.516.253,81
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 634.185.961,98
TÍTULOS PÚBLICOS - CVS	R\$ 11.899.642,80
IMÓVEIS	R\$ 60.353.005,55
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EXECUTIVO	R\$ 12.873.479,97
TOTAL	R\$ 5.147.828.344,11
ASSEMBLEIA LEGISLATIVA	SALDO
ALE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 10.488.302,62
ALE FPREV TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.140.728,62
ALE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 116.166,02
ALE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 441.964,73
ALE FFIN DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - ALE COBERTURA	R\$ -
TOTAL	R\$ 13.187.161,99
PROCURADORIA GERAL DE JUSTIÇA - PGJ/MPE	SALDO
MPE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 147.439.641,94
MPE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 320.493,67
MPE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 774.087,77
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - PGJ/MPE - FFIN	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - MPE COBERTURA	R\$ 189.118,29
TOTAL	R\$ 148.723.341,67
DEFENSORIA PÚBLICA - DPE/AM	SALDO
DPE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 13.406.924,99
DPE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
DPE - FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 691.424,82
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - DPE - FFIN	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - DPE COBERTURA	R\$ -
TOTAL	R\$ 14.098.349,81
TRIBUNAL DE JUSTIÇA - TJ/AM	SALDO
TJ/AM FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 379.077.245,76
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA	R\$ 1.318.043,50
TJ/AM - FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 25.762.658,64
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA - FPREV	R\$ 1.193.332,81
TOTAL	R\$ 407.351.280,71
TRIBUNAL DE CONTAS DO ESTADO - TCE/AM	SALDO
TCE/AM FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 139.595.475,57
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TCE	R\$ 978.717,74
TCE/AM - FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 4.250.694,57
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TCE/FPREV	R\$ 445.775,50
TOTAL	R\$ 145.270.663,38
OUTROS RECURSOS	SALDO
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO EXECUTIVO	R\$ 44.379.810,54
DISP. FINANCEIRA - TAXA DE ADM. EXECUTIVO	R\$ 1,00
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - ALE	R\$ 878.800,66
DISP. FINANCEIRA - TX DE ADM. ALE	R\$ 65.782,15
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO TCE	R\$ 380.400,14
DISP. FINANCEIRA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO TCE	R\$ -
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO TJA	R\$ 1.248.446,40
DISP. FINANCEIRA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO TJA	R\$ 144.126,44
FUNDO FINANCEIRO - EXECUTIVO	R\$ 17.153.951,63
FUNDO FINANCEIRO - COMPREV	R\$ 4.310.739,03
DISP. FINANCEIRA - FFIN EXECUTIVO	R\$ 6.458.213,21
DISP. FINANCEIRA - FFIN EXECUTIVO - COBERT. DEFICIT	R\$ 34.924,55
DISP. FINANCEIRA - SAL. NÃO RECLAMADOS	R\$ 74.576,64
DISP. REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 4.519.317,05
TOTAL	R\$ 79.649.084,44
TOTAL GERAL	R\$ 5.956.108.226,11

Quadro 45



 B
 27

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

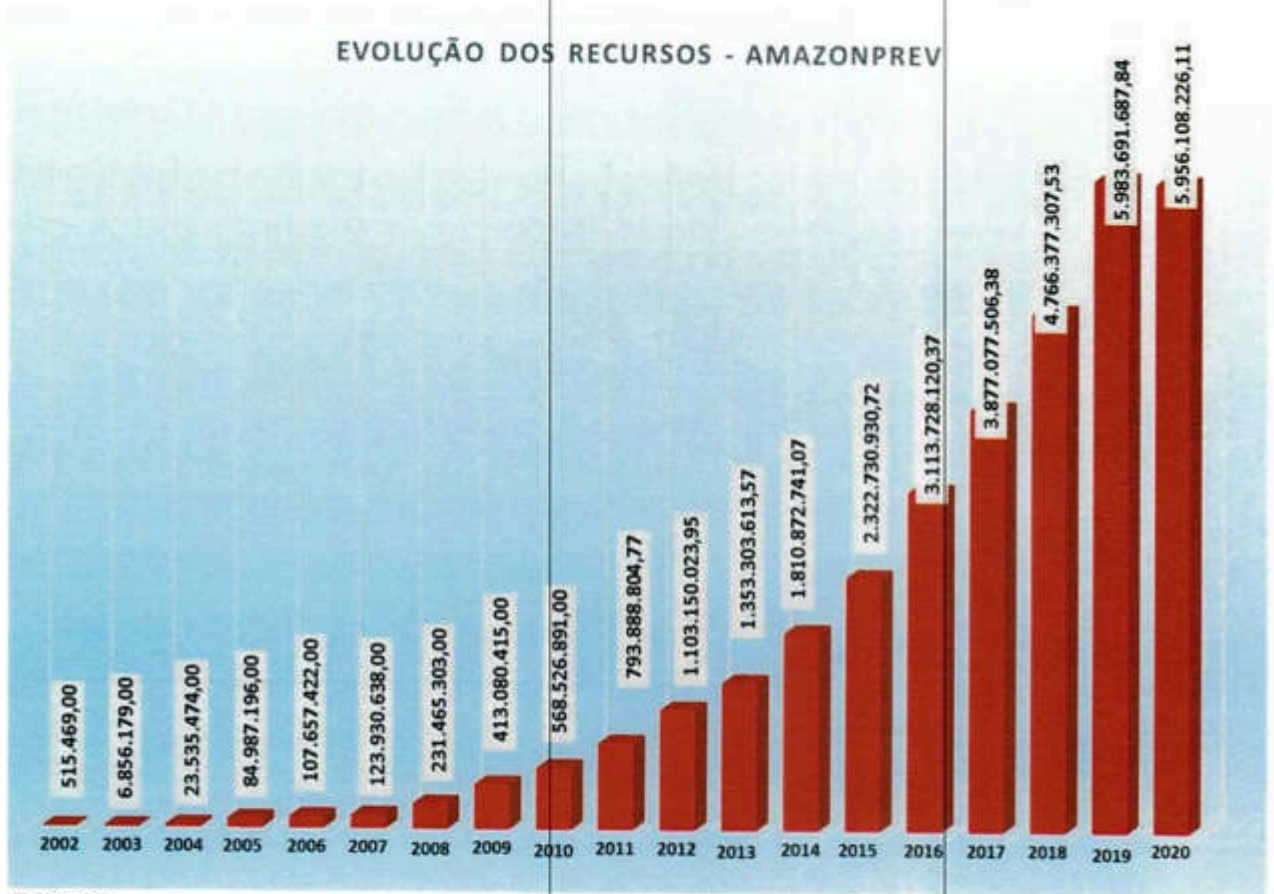


Gráfico 5.

[Handwritten signature]
28

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

15. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV EXECUTIVO:	<p>a) Novos Recursos: 1. Havendo indicação de que o mercado financeiro projeta retorno de normalidade para a RV, devem ser direcionados os recursos entre os fundos: R\$ 20 milhões AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC FIA (CNPJ/MF 34.791.108/0001-61); R\$ 20 milhões SUL AMÉRICA EQUITIES FIA (11.458.144/0001-02); OCCAM FICFIA (11.628.883/0001-03); SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR (19.436.818/0001-80); senão, manter anterior: direcionar para o fundo ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP (19.719.727/0001-51) o montante de R\$ 11.000.000,00 (onze milhões de reais), até o limite permitido pela legislação, direcionado os demais valores recebidos para o fundo CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA, (23.215.097/0001-55)</p> <p>b) Recursos Atuais: 1. Migrar R\$ 50 milhões aplicados nos fundos BB Previdenciário Alocação para o fundo Safra IMA Institucional RF; 2. Migrar R\$ 150 milhões do fundo BB Previdenciário Alocação para o fundo BB Previdenciário IMA B 5+</p>	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	16/04/2020
FPREV ALE:	<p>Recursos Atuais: direcionar os recursos para o fundo Caixa Gestão Estratégica, Itaú Alocação Dinâmica e Icatu Vanguarda Inflação CP LP.</p>	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	16/04/2020
FPREV MPE/PGJ:	<p>Novos Recursos: Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Alocação Dinâmica, visando obter resultados acima do CDI no Longo prazo</p>	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	16/04/2020
FPREV - DPE/AM	<p>Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Alocação Dinâmica, visando obter resultados acima do CDI no Longo prazo.</p>	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	16/04/2020
FPREV - TJ/AM	<p>Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Institucional FIC FI RF IMA-B 5</p>	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	16/04/2020
FPREV - TCE/AM	<p>Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Institucional FIC FI RF IMA-B 5</p>	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	16/04/2020
Outros Repasses – TCE e TJAM	<p>a) Novos recursos: os novos recursos recebidos pelo TCE e TJAM, devem ser direcionados para o fundo Maxi Poder Público</p>	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	16/04/2020
FFIN - EXECUTIVO, ALE, DPE e MPE	<p>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.</p>	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	16/04/2020
RECURSOS COMPREV	<p>Manter os recursos aplicados no fundo Bradesco Alocação Dinâmica, de forma manter o enquadramento dos recursos da Amazonprev</p>	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	16/04/2020
DISPONIBILIDADES DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	<p>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.</p>	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	16/04/2020
VISITAS INSTITUCIONAIS	<p>Ficam suspensas todas as visitas de instituições financeiras programadas para os meses de março e abril/2020, devendo serem reprogramadas posteriormente. Medida busca adequar a rotina do Comitê ao Plano de Contenção do Corona Virus.</p>	COMIV	-

Quadro 46.

B
29

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

16. RELATÓRIO DE RISCO DOS ATIVOS

16.1 ACOMPANHAMENTO DOS RISCOS POR FUNDO DE INVESTIMENTOS

FUNDOS DE INVESTIMENTOS	VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE	DRAWDOWN	
	MÊS %	12 M %	MÊS %	12 M %	12 M %	MÊS %	12 M %
BB PREVID RF IRFM 1 TP	0,14%	0,25%	0,25%	0,44%	2,78370	0,00%	-0,03%
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC DE FI	2,21%	2,32%	3,66%	3,87%	2,53730	-0,54%	-1,22%
BB PREVID TIT PUB VII FI	0,80%	1,19%	1,33%	1,99%	2,96894	-0,14%	-0,52%
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	31,16%	18,66%	50,76%	30,75%	0,25454	-14,41%	-14,41%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	2,12%	2,17%	3,51%	3,62%	2,37231	-0,55%	-1,20%
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	35,31%	18,17%	57,65%	29,99%	1,02843	-12,48%	-12,48%
BRADESCO FI REFER DI PREMIUM	0,03%	0,06%	0,07%	0,00%	-1,78462	0,00%	0,00%
BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL	31,61%	18,75%	51,53%	30,89%	0,38204	-13,28%	-13,28%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	1,89%	2,05%	3,14%	3,42%	3,11518	-0,30%	-0,81%
BRADESCO MAXI PD PÚBLICO	0,02%	0,05%	0,05%	0,10%	-4,61093	0,00%	0,00%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	31,00%	18,17%	50,61%	29,98%	0,99685	-11,61%	-11,61%
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	9,80%	3,82%	15,98%	6,30%	-1,04283	-2,68%	-2,68%
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	9,60%	4,79%	15,70%	7,92%	1,05412	-2,69%	-3,54%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF	1,75%	1,97%	2,92%	3,29%	3,19572	-0,27%	-0,71%
CAIXA FI BRASIL IRFM 1	0,14%	0,25%	0,24%	0,43%	3,17233	0,00%	-0,03%
CAIXA FIA CONSUMO	33,24%	19,57%	54,11%	32,31%	1,36170	-15,08%	-15,08%
CAIXA GESTÃO ESTRATEGICA	1,87%	3,43%	3,11%	5,69%	2,54154	-0,32%	-2,73%
ICATU DIVIDENDOS FIA	24,89%	15,57%	40,56%	25,69%	0,89333	-10,59%	-10,59%
ICATU INFLAÇÃO CRÉDITO PRIVADO	1,82%	1,95%	3,03%	3,26%	3,00762	-0,26%	-1,13%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA	1,79%	2,01%	2,98%	3,36%	3,16769	-0,28%	-0,74%
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA	7,70%	7,31%	12,69%	12,10%	2,21156	-2,62%	-4,89%
ICATU VANGUARDA AÇÕES IBx FI	32,03%	19,04%	52,21%	31,36%	0,21369	-13,84%	-13,84%
ITAU AÇÕES PHOENIX FIC FI	31,58%	19,10%	51,43%	31,50%	0,73980	-13,52%	-13,52%
ITAU DUNAMIS FIC	30,58%	18,14%	49,74%	29,92%	0,74125	-13,29%	-13,29%
ITAU FOF RPI AÇÕES	30,92%	18,07%	50,42%	29,78%	0,49779	-12,35%	-12,35%
ITAU SMALL CAPS VALUATION	36,16%	19,33%	59,02%	31,92%	1,39137	-14,99%	-14,99%
ITAU INSTIT ALOC DINÂMICA RF FIC	0,01%	1,69%	0,03%	2,81%	2,39567	0,00%	-1,15%
SAFRA IMA INST. FI FIC RF	5,62%	5,43%	9,27%	8,99%	2,29378	-1,65%	-3,33%
SAFRA S&P REAIS PB MM	29,78%	14,64%	48,57%	24,12%	0,29466	-11,87%	-11,87%
SANTANDER AÇÕES TOP SELEÇÃO	32,63%	18,86%	53,16%	31,06%	0,26656	-14,22%	-14,22%
SANTANDER ATIVO RENDA FIXA	0,26%	2,37%	0,44%	3,94%	1,79841	-0,03%	-1,64%
SANTANDER ATIVO FIC RF	0,26%	2,37%	0,44%	3,94%	1,79841	-0,03%	-1,64%
SANTANDER SELEÇÃO 30	32,75%	18,82%	53,36%	30,99%	0,25314	-14,25%	-14,25%
SANTANDER IBOVESPA AÇÕES	33,41%	19,11%	54,46%	31,48%	0,18945	-14,36%	-14,36%

RISCOS DA CARTEIRA AMAZONPREV

CARTEIRA AMAZONPREV	9,24%	3,82%	15,08%	6,32%	1,26848	-3,38%	-3,38%
---------------------	-------	-------	--------	-------	---------	--------	--------

Quadro 47.

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

30

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

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

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

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

C

af
B
31

16.2 DETALHAMENTO POR FUNDO DE INVESTIMENTOS

FUNDOS DE INVESTIMENTOS	CVMF	GESTOR	ESPECIFICAÇÃO	RISCOMARK	VALDO	PRazo DE DEBATE DO ATIVO	PRazo DE RESGATE	LIQUIDEZ	VOLATILIDADE ATRIBUÍDA PELO ADMINISTRADOR	CONVÊNIO DE VOLATILIDADE REFERENCIADA (BOLSA)	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO
BB PREVID Rf IRM 1 TP	11.528.882/0001-75	BB DTVM	ART. 7.º, I, "a"	RM-MI	R\$ 145.237.314,46	INDETERMINADO	D=1	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	2,500%
BRASESCO FI REFER DE PREMIUM	03.599.413/0001-90	BRAM - DTVM	ART. 7.º, IV, "a"	CDI	R\$ 396.745.966,32	INDETERMINADO	D=0	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,200%
BRASESCO FI Rf MARI PODER PUB	08.146.263/0001-97	BRAM - DTVM	ART. 7.º, IV, "a"	CDI	R\$ 41.302.272,80	INDETERMINADO	D=0	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,200%
NTN-B	-	TESOURO NACIONAL	ART. 7.º, I, "a"	IPCA + 6,88% a.a.	R\$ 154.813.643,12	15/05/2027	D=1	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
NTN-B	-	TESOURO NACIONAL	ART. 7.º, I, "a"	IPCA + 5,97% a.a.	R\$ 158.905.300,25	15/08/2030	D=1	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
NTN-B	-	TESOURO NACIONAL	ART. 7.º, I, "a"	IPCA + 5,90% a.a.	R\$ 160.138.570,47	15/08/2030	D=1	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
NTN-B	-	TESOURO NACIONAL	ART. 7.º, I, "a"	IPCA + 6,07% a.a.	R\$ 162.469.376,23	15/08/2040	D=1	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
CVS-A	-	TESOURO NACIONAL	Em engajamento	0,50% a.m.	R\$ 1.411.985,98	01/01/2027	-	LONGO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
CVS-B	-	TESOURO NACIONAL	Em engajamento	1,17% a.a.	R\$ 3.385.780,58	01/01/2027	-	LONGO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
CVS-C	-	TESOURO NACIONAL	Em engajamento	0,92% a.m.	R\$ 185.780,12	01/01/2027	-	LONGO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
CVS-D	-	TESOURO NACIONAL	Em engajamento	3,17% a.a.	R\$ 1.018.118,29	01/01/2017	-	LONGO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
BB PREVID ITI PUB VII FI	10.523.300/0001-08	BB DTVM	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B	R\$ 19.428.475,41	INDETERMINADO	D=1	MÉDIO PRAZO	2	BAIXO	0,200%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA	10.822.432/0001-03	ICATU VANGUARDIA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B 5	R\$ 54.751.029,81	INDETERMINADO	D=1	CURTO PRAZO	2	BAIXO	0,400%
CAIXA FI BRASIL REF AM 1 TÍTULOS PÚBLICOS Rf	10.740.820/0001-06	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	ART. 7.º, I, "b"	IB-MI	R\$ 267.261.005,19	INDETERMINADO	D=0	CURTO PRAZO	2	BAIXO	0,200%
BRASESCO FIC FI Rf ALICIAÇÃO DINÂMICA	28.535.824/0001-09	BRAM - DTVM	ART. 7.º, IV, "a"	IPCA	R\$ 123.748.430,41	INDETERMINADO	D=4	CURTO PRAZO	2	BAIXO	0,400%
SAFRA S&P REAS PR MM	21.595.623/0001-54	SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA	ART. 8.º, II	CHI	R\$ 17.875.827,94	INDETERMINADO	D=2	CURTO PRAZO	2	BAIXO	0,200%
BRASESCO FIC Rf IMA B5	20.216.216/0001-04	BRAM - DTVM	ART. 7.º, IV, "a"	IMA-B 5	R\$ 311.413.633,14	INDETERMINADO	D=1	CURTO PRAZO	3	MÉDIO	0,200%
CAIXA BR GESTÃO ESTRATÉGICA	23.275.097/0001-55	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7.º, IV, "a"	IPCA	R\$ 399.435.352,21	INDETERMINADO	D=0	CURTO PRAZO	3	MÉDIO	1,000%
CAIXA FI BRASIL 2020V TP Rf	22.791.026/0001-27	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7.º, I, "a"	IMA-B	R\$ 43.778.431,26	16/09/2024	-	MÉDIO PRAZO	3	MÉDIO	1,000%
CAIXA FI BRASIL 2024V TP Rf	22.791.024/0001-26	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7.º, I, "a"	IMA-B	R\$ 54.264.294,55	16/09/2024	-	LONGO PRAZO	3	MÉDIO	2,000%
SANTANDER BEMDA ITXA ATIVO FIC FI	26.502.132/0001-06	SANTANDER BRAUUL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, I, "b"	IPCA	R\$ 40.796.399,81	INDETERMINADO	D=1	CURTO PRAZO	3	MÉDIO	0,400%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP Rf	11.661.913/0001-10	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7.º, I, "a"	IMA-B 5	R\$ 625.474.431,84	INDETERMINADO	D=0	CURTO PRAZO	3	MÉDIO	0,400%
BITU ABSOLUTO FIC IMA	11.977.796/0001-64	BITU Pictus Asset Management S.A. DTVM	ART. 8.º, II, "a"	BOVESPA	R\$ 206.508.830,30	INDETERMINADO	D=31	CURTO PRAZO	4	AUTO	1,000%
CAIXA FIC CONSUNDO	10.572.532/0001-29	CAIXA ECONÔMICA	ART. 8.º, II, "a"	ECON	R\$ 89.271.388,17	INDETERMINADO	D=3	CURTO PRAZO	4	AUTO	0,10% a 0,10%
ICATU DIVIDENDOS FIA	08.279.304/0001-41	ICATU VANGUARDIA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8.º, II, "a"	BOVESPA	R\$ 253.696.725,94	INDETERMINADO	D=4	CURTO PRAZO	4	AUTO	0,200%
ICATU INFLAÇÃO CREDITO PRIVADO	19.779.227/0001-51	ICATU VANGUARDIA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, VII, "a"	IMA-B 5	R\$ 13.480.340,27	INDETERMINADO	D=27	CURTO PRAZO	4	AUTO	0,200%
BRASESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES MID SMALL CAPS	06.988.621/0001-09	BRAM - DTVM	ART. 8.º, IV, "a"	IBIX	R\$ 122.375.345,58	INDETERMINADO	D=1	CURTO PRAZO	4	AUTO	1,500%
BR AÇÕES VALOR FIC FI EM AÇÕES	29.258.294/0001-38	BR DTVM	ART. 8.º, IV, "a"	-	R\$ 88.930.763,25	INDETERMINADO	D=32	CURTO PRAZO	4	AUTO	2,000%
BRASESCO FIC AÇÕES INSTITUCIONAL IMA ALPHA	34.099.376/0001-78	BRAM - DTVM	ART. 8.º, I, "a"	BOVESPA	R\$ 30.376.181,29	INDETERMINADO	D=2	CURTO PRAZO	4	AUTO	0,500%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIA	30.859.384/0001-74	BANCO I. SAFRA S/A	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B	R\$ 65.806.850,40	INDETERMINADO	D=4	CURTO PRAZO	4	AUTO	0,300%
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA	10.798.542/0001-08	ICATU VANGUARDIA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B 5	R\$ 111.505.790,38	INDETERMINADO	D=1	CURTO PRAZO	4	AUTO	0,200%
ICATU VANG. IBI FIC AÇÕES	08.278.715/0001-31	ICATU VANGUARDIA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8.º, I, "a"	BOVESPA	R\$ 24.024.425,41	INDETERMINADO	D=1	CURTO PRAZO	4	AUTO	0,25% a 0,40%
ITALU INSTIT ALOC DINÂMICA I	21.838.100/0001-49	ITALU BANCANO S/A	ART. 7.º, IV, "a"	IPCA	R\$ 240.077.666,80	INDETERMINADO	D=4	CURTO PRAZO	4	AUTO	0,200%

Quadro 48.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

FUNDOS DE INVESTIMENTOS	CNPJ	GESTOR	ENQUILTRAMENTO	RECEBÍVEIS	SALDO	PRazo DE INDICAÇÃO DO ATIVO	PRazo DE RESGATE	LIQUIDEZ	VOLATILIDADE ATRIBUÍDA PELO ADMINISTRADOR	CONCITO DA VOLATILIDADE REPRESENTADA (RISCO)	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO
BE PREVIDENCIÁRIO DE ALOCAÇÃO ATIVA FIC DE FI	25.078.994/0001-90	BE DTVM	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B	R\$ 1.150.702.160,24	INDETERMINADO	D=1	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	0,300%
SANTANDER IRONIESPA INSTITUCIONAL AÇÕES	03.699.680/0001-02	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8.º, II, "a"	IRONIESPA	R\$ 99.578.296,98	INDETERMINADO	D=1	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	0,760%
ITAU AÇÕES PHIDENIR FIC FI	23.731.629/0001-07	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 8.º, II, "a"	IRONIESPA	R\$ 149.286.152,85	INDETERMINADO	D=24	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	1,900%
SANTANDER SELEÇÃO 30	29.549.642/0001-26	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8.º, II, "a"	IRONIESPA	R\$ 46.892.818,40	INDETERMINADO	D=29	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	2,00% a 2,50%
ITAU SMALL CAP VALLIATION	01.063.897/0001-05	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 8.º, II, "a"	IRONIESPA	R\$ 52.473.264,14	INDETERMINADO	D=1	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	2,000%
ITAU DINAMIS FIC FIA	24.571.992/0001-75	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 8.º, II, "a"	IRONIESPA	R\$ 161.862.161,70	INDETERMINADO	D=14	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	1,500%
ITAU FOF IBI AÇÕES	08.812.434/0001-10	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 8.º, II, "a"	IRONIESPA	R\$ 9.694.861,74	INDETERMINADO	D=5	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	0,400%
SANTANDER AÇÕES TOP SELEÇÃO	03.486.763/0001-05	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8.º, II, "a"	IRONIESPA	R\$ 69.610.071,08	INDETERMINADO	D=4	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	0,500%
				TOTAL	R\$ 1.791.835.007,13						
				TOTAL	R\$ 5.827.122.483,05						

Quadro 48-A

(Handwritten mark)

(Handwritten signature)
(Handwritten signature)
 B
 33

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

VOLATILIDADE DA CARTEIRA COM BASE NA NOTA DE RISCO DO ADMINISTRADOR

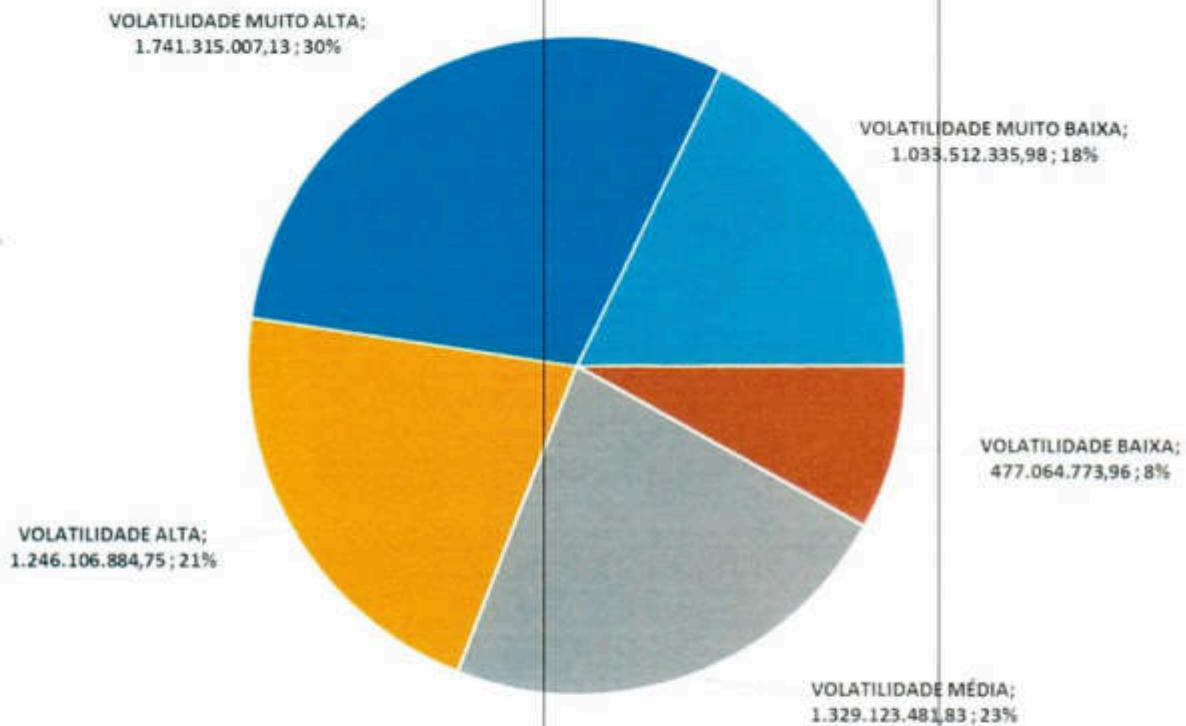


Gráfico 6.

(Handwritten signatures and initials)

34

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2020

17. VERIFICAÇÃO DE LASTRO DOS FUNDOS DE RISCO DE CRÉDITO

02/03/2020

TABELA - DURATION & YIELD POR CLASSE			
Nome	Duração	Yield	%
ISIS	0,36	3,21%	0,0%
ISB	0,00	0,00%	0,0%
ISF	2,42	0,48%	11,8%
ISD	0,93	0,48%	1,0%
ISPC2	0,00	0,00%	0,0%
ISF	2,32	0,48%	0,7%
ISDC	0,00	0,00%	0,0%
NTN-0	5,11	-	16,1%
Over	0,00	-	3,4%
Carteira Crédito	3,38	1,08%	78,3%
Crédito - Contribuição Titulo	0,86	0,84%	78,3%
Fundo Invest DIF e NTN-0	2,72	0,84%	100,0%

TABELA - RATING EXTERNO		
Nome	Valor	%
AAA	137.080.253	25,0%
AA+	51.349.089	11,4%
AA	124.807.961	23,3%
AA-	15.532.057	3,0%
A+	40.113.880	7,4%
ISPC2	0	0,0%
A	7.137.086	1,3%
A-	2.091.847	0,4%
BBB+	19.610.939	3,7%
BBB	0	0,0%
BBB-	2.011.347	0,4%
BB+	0	0,0%
BB	0	0,0%
BB-	1.960.690	0,4%
B+	0	0,0%
B	0	0,0%
B-	0	0,0%
CCC	0	0,0%
CC	0	0,0%
C	0	0,0%
sem Rating	0	0,0%
Totais / Over	117.525.783	21,0%
Total	535.826.826	100,0%

* Fonte: Moody's & Standard & Poor's. Última atualização: Junho 2019. Moody's e S&P.

TABELA - SETOR		
Nome	Valor	%
Eletricidade	124.883.995	23,3%
Bancos	72.074.689	13,4%
Saneamento	46.354.222	8,6%
Com. Distribuição	41.841.223	7,8%
Serviços	38.833.749	7,2%
Outros	17.593.404	3,3%
Mineração e Siderurgia	16.272.874	3,0%
Varejo	16.179.773	3,0%
Holding	15.817.490	3,0%
Consumo	14.792.074	2,8%
Shopping Center	17.024.234	3,2%
Infraestrutura	4.546.768	0,8%
Papel e Celulose	3.262.170	0,6%
Logística	2.983.420	0,6%
Tecologia / Over	117.525.783	21,9%
Total	535.826.826	100,0%

TABELA - EMISOR		
Nome	Valor	%
Comg Distribuição	18.630.930	3,5%
Luiza Americanas	16.179.773	3,0%
São Paulo Energia	15.893.404	3,0%
Agua de Guaranés	14.849.962	2,8%
Natura	14.792.074	2,8%
Libel Participações	12.707.694	2,4%
Cooper	12.581.441	2,3%
Usiminas	11.426.948	2,1%
POST	10.871.894	2,0%
AGS Tera Energia	10.517.587	2,0%
CSB Autostar	10.143.834	1,9%
Imanorte	9.843.160	1,8%
Petrobras	9.746.750	1,8%
Força das Bandeiras	9.648.170	1,8%
Enxofre	9.202.420	1,7%
Eletronor	9.096.464	1,7%
Latam	8.742.267	1,6%
Dasa	8.694.621	1,6%
Repositil	8.574.552	1,6%
Dasa	8.517.180	1,6%
Comg	7.710.051	1,4%
Itaú	7.683.800	1,4%
Sanepar	7.589.064	1,4%
Multilabs	7.261.230	1,4%
Luiza	6.953.000	1,3%
Rapto Intercont	6.875.590	1,3%
Capel	6.267.210	1,2%
Light USA	5.876.027	1,1%
Acta	5.807.764	1,1%
Enxofre	5.685.140	1,1%
Tetra	5.550.028	1,0%
Tribunais	5.371.254	1,0%
CAAT	5.260.690	1,0%
Pau	5.207.261	1,0%
Localiza	5.206.258	1,0%
Vale	4.820.890	0,9%
Omega (Cerrado)	4.555.127	0,8%
Cardi	4.546.768	0,8%
Transportadora	4.527.040	0,8%
CDP	4.444.049	0,8%
Equatorial Energia	3.836.074	0,7%
Algar	3.766.282	0,7%
SNV	3.571.140	0,7%
CPFL (Geração de Energia)	3.481.826	0,7%
Arborelign	3.373.759	0,6%
Suzano	3.262.250	0,6%
Caixa	3.254.267	0,6%
Unilever	3.185.340	0,6%
Eletronor	3.077.689	0,6%
Itaú	3.049.590	0,6%
MRI Logística	2.983.420	0,6%
ABC Brasil	2.953.967	0,6%
Econômic	2.893.490	0,5%
Itaú It	2.760.294	0,5%
Paraná	2.651.847	0,5%
Santa André Energia	2.611.347	0,5%
Itaú (Over)	2.563.860	0,5%
SANTO13	2.126.240	0,4%
Mercado	2.126.259	0,4%
São Manuel Energia	2.061.844	0,4%
EDP Participações	1.859.110	0,3%
CAISA	1.826.520	0,3%
Ecopar	1.796.530	0,3%
Dasa	1.492.238	0,3%
EDP Energia	1.481.622	0,3%
Guarani	981.524	0,2%
Caixa	837.310	0,2%
Autoresil	895.000	0,2%
Alterosa Sane	736.642	0,1%
Tecologia / Over	117.525.783	21,9%
Total	535.826.826	100,0%

Quadro 49.

Nota: Acompanhamento de Verificação de Lastro relativo ao Título ou papel incluídos em operações estruturadas adquiridas por meio de veículos de investimento.

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 18 de março de 2020, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de fevereiro/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 foram analisadas pelo Controles Internos, e, posteriormente, aprovadas pela Diretoria dessa Fundação Amazonprev.

Manaus – AM, 18 de março de 2020.


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

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: