Destino: DIRAF / PRESI

Assunto: Relatório de Investimentos – Maio/2020

Data: 15/06/2020

RELATÓRIO Nº. /2020 – COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **Abril/2020**, destacando:

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 03 a 07);
- 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 08 a 13)
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário FPREV Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas ALE/FPREV (páginas 13 a 15)
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário FPREV Ministério Público Estadual/PGJ MPE-PGJ/FPREV (página 15 a 16)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário FPREV Defensoria Pública Estadual DPE/FPREV (página 16 a 17)
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário FPREV Tribunal de Justiça TJ/FPREV (página 17 a 18)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário FPREV Tribunal de Contas do Amazonas TCE/FPREV (páginas 18 a 19)
- 8) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado FPREV (página 20)
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro: Executivo, DPE, ALE e MPE (páginas 21 a 22)
- **10**) Disponibilidades da Taxa de Administração (página 22)
- 11) Outros Recursos do Tribunal de Justiça TJ/AM: Saldos e Composição (páginas 23)
- 12) Outros Recursos Tribunal de Contas do Estado TCE: Saldos e Composição (página 23)
- 13) Enquadramento das Aplicações Financeiras (páginas 24 a 27)
- **14**) Total consolidado e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 28 a 29)
- 15) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 30)
- **16**) Relatório de Risco dos Ativos (páginas 31 a 35).
- 17) Verificação de Lastro dos Fundos de Risco de Crédito (página 36)
- **18)** Parecer do Comitê de Investimentos (página 37).
- 19) Aprovação do Conselho Fiscal (página 38).

1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

No último mês, a evolução dos dados da pandemia continuou apresentando números elevados, mantendo as incertezas sobre desenrolar dos impactos no Brasil. As discussões sobre uma possível retomada das atividades comerciais se intensificaram com a divulgação de planos de retorno das atividades, com destaque para os apresentados pelas cidades do Rio de Janeiro e São Paulo. Todavia, ainda permanecem dúvidas sobre como será o processo de retomada, principalmente, no tocante ao comportamento das pessoas e, consequentemente, nos efeitos na atividade econômica do país.

Na tentativa de amenizar os efeitos do COVID-19 sobre a economia, os bancos centrais pelo mundo adotaram medidas monetárias focadas na liquidez e manutenção da funcionalidade dos mercados e medidas fiscais focadas em transferências de renda para famílias e empresas. O total estimado de medidas anunciadas (monetárias + fiscais) das economias avançadas totalizam até agora US\$ 12,9 trilhões, sendo 54% medidas fiscais e 46% medidas monetárias. Destaque recente para as medidas de expansão monetária e fiscal da União Europeia e de alguns países da região.

Nesse cenário de crise e de estímulos fiscais, o Comitê de Política Monetária (Copom) reduziu a taxa Selic em 75 p.b. e sinalizou novo corte na próxima reunião, de magnitude não superior à atual. Em decisão unânime, a Selic passou de 3,75% para 3,00% a.a.. A avaliação do Copom é de que a pandemia está provocando efeitos superiores em termos de desaceleração do crescimento global, queda dos preços das commodities e aumento da volatilidade dos preços de ativos financeiros, o que torna o ambiente desafiador para as economias emergentes. As medidas monetárias anunciadas pelo governo brasileiro representam 33% do PIB (foco em liquidez e funcionalidade dos mercados).

Com relação ao cenário básico para a inflação, o Comitê avalia que existem riscos em ambas as direções. De um lado, o nível elevado de ociosidade, com a redução da demanda por conta dos efeitos do isolamento social, deve produzir trajetória de inflação abaixo do esperado. Por outro lado, uma maior deterioração da trajetória fiscal, em função do aumento de gastos relacionados à pandemia, bem como a incerteza em relação às reformas que podem elevar os prêmios de risco para o país, elevando a taxa de juros estrutural. Assim, o Comitê indicou que esse cenário prescreve estímulo monetário elevado, mas a magnitude dos ajustes adicionais dependerá tanto dos desdobramentos de política fiscal como da evolução dos indicadores de atividade.

O PIB do 1º trimestre de 2020 registrou queda de 1,5%. Em relação ao mesmo período do ano passado, o recuo foi de 0,3%. Na comparação trimestral, pela ótica da demanda, houve queda do consumo das famílias (-2,0%) e das exportações (0,9%). Pela ótica da oferta, apresentaram queda

os setores de serviços (-1,6%) e indústria (-1,4%), enquanto agropecuária apresentou crescimento (0,6%). O impacto das medidas de isolamento social sobre o crescimento do 1º trimestre de 2020, que afetou apenas 1/6 do trimestre, corrobora uma expectativa de queda de magnitude expressiva da atividade no 2º trimestre. No entanto, ainda há muitas incertezas com relação a capacidade de reação da economia, as principais instituições financeiras do país estimam retração do PIB variando entre 5% a 8%. Mas são dados que serão sempre revistos à medida que a economia retome as atividades.

Quando se fala de retomada da economia, é preciso dizer que houve destruição recorde de 1,2 milhão de empregos formais nos meses de março e abril. Segundo os indicadores do Caged e com o ajuste sazonal, o saldo negativo de criação de vagas de emprego formal foi de 222 mil em março e de 958 mil em abril, o pior mês já registrado. Adicionalmente, segundo os dados da PNAD, que abrangem também o setor informal, quase 3 milhões de pessoas deixaram de ser ocupadas em abril. No entanto, o fato de muitos trabalhadores deixarem de ter procurado emprego no mês fez com que a elevação do desemprego tenha sido pequena. Se fosse mantida a taxa de participação constante, a taxa de desemprego com ajuste sazonal seria de 14,2%, ante os 12,0% efetivamente registrados no mês. Os números mostram a magnitude do efeito das medidas de isolamento social sobre a atividade, e consequentemente, sobre o mercado de trabalho. Segundo dados do Ministério do Trabalho, 8,1 milhões de trabalhadores tiveram redução de jornada ou suspensão temporária do mercado de trabalho até maio. Nas próximas leituras, os indicadores de emprego devem continuar repercutindo a evolução desfavorável da atividade.

A inflação ao consumidor (IPCA) apresentou deflação em abril e na prévia (IPCA-15) de maio. Em abril o índice variou -0,31%, Em termos qualitativos, a média dos núcleos de inflação (exclui itens voláteis) registrou deflação, de -0,01%, ao passo que, em doze meses, houve desaceleração de 2,8% para 2,4%. Já o IPCA-15 de maio variou -0,59%. Ambos resultados sinalizam continuidade do cenário benigno para a inflação. Está projetada para esse ano uma inflação de 1,6%, abaixo do piso da meta do Banco Central (de 2,5%).

Nos EUA, atividade econômica sofreu retração histórica em abril. O país registrou destruição de 20,5 milhões de vagas de emprego no mês, levando a taxa de desemprego a 14,7%. A medida mais ampla de desemprego, considerando aqueles que deixaram de buscar trabalho, alcançou 22,8%. O resultado significou a maior alta desde 1939. As vendas no varejo recuaram 16,4% e a produção industrial recuou 11,2% em abril, ambos em comparação com março. Os resultados são compatíveis com retração da ordem de 10% do PIB, em função dos impactos da pandemia.

Nesse cenário, o Fed indicou que o momento prescreve estímulos monetários. Em ata da reunião na qual o Banco manteve a taxa de juros no intervalo de 0,25% a.a. e 0% a.a., os membros

reforçaram que o cenário ainda contempla uma incerteza extraordinária para a economia, decorrente da evolução da pandemia. Sobre a atividade, há o risco de manutenção da taxa de desemprego em patamar elevado e de queda do consumo das famílias. Já a inflação deve se manter abaixo da meta, com queda da demanda, fortalecimento do dólar e redução do preço do petróleo. Com isso, parte do comitê prevê a possibilidade de aumento dos estímulos e de sua duração. Ainda em um cenário bastante incerto, o Fed deverá manter ou acelerar os estímulos nos próximos meses.

Apesar de um cenário com risco elevado para a taxa de desemprego nos EUA, o Relatório de Emprego (*Payroll*) mostra recuperação de 2,5 milhões vagas já em maio (consenso -8,0 milhões) e confirma que a economia já está nos trilhos da recuperação. Oficialmente, Desemprego caiu de 14,7% para 13,3% com o retorno de 2,7 milhões de trabalhadores que estavam em layoff temporário, número que superou em muito as 384 mil demissões definitivas no mês. Dado surpreendeu até os mais otimistas e indica uma retomada mais vigorosa que o esperado da atividade após redução das restrições sanitárias.

Na China, começa a retomada gradual da atividade, mas diante das incertezas autoridades decidem não fixar meta de crescimento para o ano. A produção industrial do país se elevou 3,9% na comparação anual em abril e as vendas no varejo recuaram 7,5%, após queda de 15,8% em março. O primeiro-ministro chinês, Li Keqiang, defendeu que o país deve priorizar a estabilização do emprego e a redução da pobreza. Nesse sentido, o governo não adotou meta de crescimento, mas fixou como objetivo a criação de 9 milhões de empregos neste ano, com aumento dos gastos em infraestrutura. De modo geral, os dados diários de atividade na China sugerem uma retomada gradual, compatível com crescimento de cerca de 2% do PIB em 2020.

Um dado importante sobre maio é o PMI (*Purchasing Managers' Index*) da Indústria Global que registrou uma retomada ao subir 2,7 pontos em maio, após ter despencado 9,2 pontos em abril.

O indicador dos avançados subiu 3,0 pontos, puxado principalmente pela Europa e UK, ao passo que o dos emergentes avançou apenas 2,3 pontos. A reabertura gradual de boa parte das economias parece ter se refletido em incipiente recuperação da indústria. A disseminação da reabertura em mais regiões do globo aponta para continuada aceleração dos PMIs à frente. (Fonte: Relatório Síntese Mensal – BRAM / Notas Econômicas – BBDTVM / Relatório Semanal de Mercado – BNP Paribas).

DESEMPENHO DOS FUNDOS DE RENDA FIXA

Crédito Privado

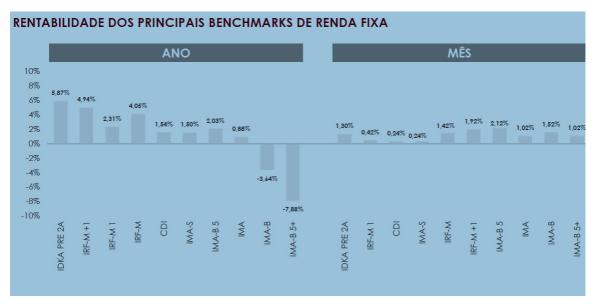
Os fundos tiveram desempenho superior ao CDI, em linha com a estabilização do mercado de crédito. As debêntures foram responsáveis pelo retorno positivo deste mês, parte disso vem do fechamento de spreads de ativos que sofreram muito desde o início da crise Os fundos estão majoritariamente mais concentrados em ativos corporativos e letras financeiras, com ampla diversificação de setores de atividade econômica No ano, o total de crédito destas carteiras está maior, na ordem de 0,8%

Juro Real

Em maio, os fundos que investem em ativos indexados à inflação obtiveram desempenho positivo e acima do indicador devido à queda das taxas reais, que reflete uma política monetária mais expansionista.

Ativos

Em maio, os fundos com estratégia de renda fixa ativa apresentaram retornos positivos e acima do CDI, em linha com a tendência de queda da taxa Selic, refletindo uma política monetária expansionista O gestor aumentou a alocação em ativos prefixados, no curto e médio prazo, em detrimento dos atrelados à inflação, adicionalmente zerou a exposição que detinha nesta classe Todas as exposições se beneficiaram da postura do Banco Central na condução da política monetária.



Os fundos de investimentos em Renda Fixa que a Amazonprev mantém em carteira, em sua maioria, são indexados aos índices ANBIMA (IMA). A principal estratégia nesse segmento tem sido aportar recursos em fundos com gestão ativa, em específico o fundo Caixa Gestão Estratégica, devido os resultados acumulados no período, além de ser composto exclusivamente por Títulos Públicos.

Para 2020, devido os efeitos da Pandemia sobre a economia, o Banco Central já reduziu a taxa Selic a 3,00% a.a., e sinalizou a possibilidade de novos cortes caso se confirme que os dados da economia sejam piores do que estão sendo projetados.

DESEMPENHO DOS FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

O mês de maio foi mais um positivo para as bolsas em geral, contrariando não só a fama negativa do mês, mas também o clima negativo para a economia local.

As bolsas dos países desenvolvidos tiveram comportamento bastante positivo, guiadas pela expectativa otimista com a saída da quarentena e impactos dos pacotes fiscais que continuam sendo anunciados pelos governos O S&P 500 teve retorno de 4,5% reduzindo a perda do ano para -5,77% (chegou a ser de 34% no ano). O índice Nasdaq, dominado pelos setores de tecnologia e varejo ligado a e commerce (grandes destaques de performance), teve retorno de 6,75 acumulando o impressionante retorno de 5,76% no ano.

No Brasil, o Ibovespa teve retorno de 8,57 acumulando queda de 24,42 no ano. Apesar da influência positiva das bolsas no exterior, a instabilidade política local, com os riscos que isso representa para o equilíbrio fiscal e sustentabilidade da dívida/solvência do país, ajuda a explicar o desempenho relativamente pior da bolsa brasileira no ano, inclusive entre as economias emergentes. Por outro lado, a expansão monetária e fiscal dos governos no mundo, os avanços da medicina no tratamento do Covid 19 o fluxo positivo do investidor local e o ambiente de baixas taxas de juros configuram uma perspectiva positiva de médio prazo para a bolsa brasileira.

Os setores ligados a commodities foram destaque de valorização (Mineração e Petróleo) devido à forte recuperação dos preços do minério de ferro e do petróleo, na esteira da dinâmica positiva de recuperação das economias dos países que estão adiantados na questão do Covid 19. O setor de serviços públicos também se destacou em consequência da volta de rumores de privatização envolvendo empresas do setor O setor de varejo continuou sendo destaque, guiado pelas empresas que tem tido sucesso no crescimento do e commerce Por outro lado, os setores de Educação e

Shoppings Properties voltaram a se destacar negativamente em função do impacto mais relevante que o Covid 19 traz para questões conjunturais e estruturais desses setores.

			,	
RENTABILIDADE DOS	DDINICIDAIC	DENICHAAADVCI	DE DENIDA VADIÁVEI	
KEINIADILIDADE DOS	FRINCIFAI3	DEINCHMAKKSI	JE KENDA VAKIAVEL	_

	MAIO	2020	12 MESES	24 MESES	36 MESES
IBOVESPA	8,57%	-24,42%	-9,92%	13,87%	39,37%
SMLL	5,07%	-30,73%	-1,69%	25,45%	48,98%
IBRX	8,52%	-24,19%	-8,92%	16,77%	41,65%
IDIV	5,00%	-25,08%	-5,50%	29,54%	45,59%
S&P 500 (USD)	4,53%	-5,77%	10,62%	11,76%	26,23%
MSCI World (USD)	4,63%	-8,93%	4,97%	2,26%	12,35%

Na tendência do mercado financeiro, os fundos de investimentos da Amazonprev também registraram bons desempenhos no mês de maio/2020, com destaque novamente para os fundos de Renda Variável.

Apesar do resultado ser positivo no mês, o acumulado anual ainda está negativo, consequência dos resultados de fevereiro e março/2020 período em que o mercado financeiro sentiu os maiores efeitos da volatilidade dos ativos com queda acentuada no valor desses papéis.

No momento, as altas consecutivas do IBOVESPA, marcam as últimas semanas, puxada pelo bom humor do mercado exterior, principalmente pelos EUA, onde de acordo com o Departamento de Trabalho, o país criou 2,5 milhões de empregos, enquanto que era esperado um aumento de 7,5 milhões de vagas fechadas que elevaria o índice da taxa de desemprego para 19,5%, mas acabou reduzida a 13,3%. Já na china, a balança comercial apresentou desempenho misto em maio, as exportações tiveram redução anual de 3,3%, bem abaixo do que se projetava, -6,5%. Há evidências que o COVID vem tendo menor impacto do que imaginado em grandes economias da Ásia, como China e Japão.

No Brasil, o investidor deverá minimizar as manifestações contrárias ao governo de Bolsonaro, mas os julgamentos de ações que deverão ocorrer no TSE e STF representam risco para o presidente. Apesar disso, a melhor perspectiva para a retomada do crescimento nos países desenvolvidos tem elevado o otimismo dos investidores, e apesar das incertezas do rumo da economia no país, nos últimos dias foi registrado um maior volume de investidor estrangeiro na bolsa de valores, implicando, inclusive, em uma valorização do real frente ao dólar e valorização dos títulos públicos de longo prazo.

A volatilidade do mercado ainda será observada nas próximas semanas, porém, comparando a expectativa de resultados entre Renda Fixa e Renda Variável, no atual cenário, é imprescindível

aumentar o índice de risco da carteira. Uma das vantagens para a Amazonprev é que, com o Nível II do pró gestão, a Fundação é classificada como Investidor Qualificado, possibilitando ter na estratégia de alocação de recursos maior percentual para alocação em fundos de ações. Já para Renda Fixa, é importante manter os recursos indexados a fundos com gestão ativa e/ou dinâmica, buscando obter resultados acima do CDI no médio e longo prazo.

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO - FPREV EXECUTIVO

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

		SALI	oos					VAL	ORIZAÇÃO	0 (%)
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA		30/04/2020		29/05/2020	mar/20	abr/20	mai/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$	737.843.515,71	R\$	687.612.970,09	(2,1012)	0,9125	1,0721	-0,1487%	0,7938%	NC
BB PREVID TP VII	R\$	19.195.307,82	R\$	19.434.867,82	(1,3412)	0,1430	1,2480	0,0329%	0,6430%	6,3062%
BB PREVID RF IMA B5+	R\$	162.978.919,70	R\$	164.604.803,83	(10,5776)	1,9189	0,9976	-7,9525%	-7,9525%	NC
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$	98.353.171,41	R\$	-	0,0100	(0,0500)	-	-0,0400%	0,5790%	3,7857%
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$	60.835.221,89	R\$	61.518.541,16	(2,1100)	1,0200	1,1200	-0,0040%	0,8150%	NC
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$	74.580.161,05	R\$	76.193.270,77	(1,7800)	0,5500	2,1600	0,8934%	2,1162%	9,4353%
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$	1.325.856,04	R\$	705.670,29	0,3100	0,2500	0,2200	0,7820%	1,4026%	4,5630%
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF	R\$	43.271.050,93	R\$	43.616.705,04	(1,1300)	(0,0300)	0,8000	-0,3689%	-0,1556%	4,5834%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$	51.209.039,94	R\$	52.823.927,15	(2,6900)	0,6900	3,1500	1,0679%	2,5887%	12,1857%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$	617.091.668,27	R\$	630.083.043,57	(1,7971)	0,4653	2,1053	0,7369%	1,9226%	9,1527%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$	477.662.951,47	R\$	514.665.096,04	(0,1306)	1,1112	1,3787	2,3713%	3,8469%	11,9840%
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$	25.241.250,37	R\$	25.794.404,49	(4,4100)	0,6200	2,1900	-1,7109%	-0,2011%	5,9851%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$	53.998.663,06	R\$	55.160.635,77	(1,8400)	0,4800	2,1500	0,7517%	1,9531%	9,2186%
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$	101.213.326,64	R\$	102.212.642,35	(11,0100)	1,9900	0,9900	-8,3406%	-8,0614%	3,8175%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$	237.011.734,71	R\$	238.292.716,00	0,5300	0,1400	0,5400	1,2144%	1,8209%	7,8320%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$	115.400.334,63	R\$	117.246.825,36	(6,7000)	1,7700	1,6000	-3,5294%	-2,5628%	NC
SANTANDER RF ATIVO FIC	R\$	93.254.608,05	R\$	93.705.276,10	0,0920	0,4446	0,4833	1,0229%	1,6378%	2,0477%
TOTAL RENDA FIXA	R\$	2.970.466.781,69	R\$	2.883.671.395,83						
TOTAL REMORTALITY	Ιζφ	2.770.400.701,07	Кø	2.883.0/1.395,83						
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO	Kφ	SALI	_	2.883.0/1.395,83				VAL	ORIZAÇÃO	
	Ιζφ		_	29/05/2020	mar/20	abr/20	mai/20	VAL TRIMESTRE		ÚLTIMOS 12 MESES
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO	R\$	SALI	oos	,	mar/20 (27,0464)	abr/20 8,3895	mai/20 7,4818			ÚLTIMOS 12
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL		SALI 30/04/2020	R\$	29/05/2020				TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$	SALI 30/04/2020 70.321.147,48	R\$	29/05/2020 75.582.464,84	(27,0464)	8,3895	7,4818	TRIMESTRE -15,0098%	2020 -23,7408%	ÚLTIMOS 12 MESES NC
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ R\$	\$ALI 30/04/2020 70.321.147,48 95.825.263,28	R\$	29/05/2020 75.582.464,84 101.746.750,51	(27,0464)	8,3895 14,5500	7,4818 6,1800	TRIMESTRE -15,0098% -16,8543%	2020 -23,7408% -22,1952%	ÚLTIMOS 12 MESES NC NC
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA BRADESCO FIA MID SMALL CAPS BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPH	R\$ R\$	\$ALI 30/04/2020 70.321.147,48 95.825.263,28 23.540.406,36	R\$ R\$	29/05/2020 75.582.464,84 101.746.750,51 25.530.907,62	(27,0464) (31,6400) (30,4300)	8,3895 14,5500 11,3900	7,4818 6,1800 8,4600	-15,0098% -16,8543% -15,9500%	2020 -23,7408% -22,1952% -23,0344%	VLTIMOS 12 MESES NC NC NC
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA BRADESCO FIA MID SMALL CAPS BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPH BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ R\$ R\$	\$ALI 30/04/2020 70.321.147,48 95.825.263,28 23.540.406,36 164.284.868,53	R\$ R\$ R\$	29/05/2020 75.582.464,84 101.746.750,51 25.530.907,62 181.168.220,48	(27,0464) (31,6400) (30,4300) (31,7100)	8,3895 14,5500 11,3900 16,5000	7,4818 6,1800 8,4600 10,2769	-15,0098% -16,8543% -15,9500% -12,2661%	2020 -23,7408% -22,1952% -23,0344% -16,8652%	VLTIMOS 12 MESES NC NC NC NC NC 3,4691%
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA BRADESCO FIA MID SMALL CAPS BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPH BTG ABSOLUTO FIQ FIA CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ R\$ R\$ R\$	\$ALI 30/04/2020 70.321.147,48 95.825.263,28 23.540.406,36 164.284.868,53 71.920.135,47	R\$ R\$ R\$ R\$ R\$	29/05/2020 75.582.464,84 101.746.750,51 25.530.907,62 181.168.220,48 77.351.283,97	(27,0464) (31,6400) (30,4300) (31,7100) (31,2266)	8,3895 14,5500 11,3900 16,5000 17,4287	7,4818 6,1800 8,4600 10,2769 7,5516	-15,0098% -16,8543% -15,9500% -12,2661% -13,1416%	2020 -23,7408% -22,1952% -23,0344% -16,8652% -19,2263%	ÚLTIMOS 12 MESES NC NC NC NC 12,2036%
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA BRADESCO FIA MID SMALL CAPS BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPH BTG ABSOLUTO FIQ FIA CAIXA CONSUMO FI AÇÕES ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI	R\$ R\$ R\$ R\$ R\$	\$ALI 30/04/2020 70.321.147,48 95.825.263,28 23.540.406,36 164.284.868,53 71.920.135,47 18.531.869,22	R\$ R\$ R\$ R\$ R\$	29/05/2020 75.582.464,84 101.746.750,51 25.530.907,62 181.168.220,48 77.351.283,97 20.232.890,20	(27,0464) (31,6400) (30,4300) (31,7100) (31,2266) (30,6200)	8,3895 14,5500 11,3900 16,5000 17,4287 10,9400	7,4818 6,1800 8,4600 10,2769 7,5516 9,1800	TRIMESTRE -15,0098% -16,8543% -15,9500% -12,2661% -13,1416% -15,9640%	2020 -23,7408% -22,1952% -23,0344% -16,8652% -19,2263% -24,2100%	ULTIMOS 12 MESES NC NC NC NC 3,4691% 12,2036% NC
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA BRADESCO FIA MID SMALL CAPS BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPH BTG ABSOLUTO FIQ FIA CAIXA CONSUMO FI AÇÕES ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ R\$ R\$ R\$ R\$ R\$	\$ALI 30/04/2020 70.321.147,48 95.825.263,28 23.540.406,36 164.284.868,53 71.920.135,47 18.531.869,22 189.416.121,53	R\$ R\$ R\$ R\$ R\$	29/05/2020 75.582.464,84 101.746.750,51 25.530.907,62 181.168.220,48 77.351.283,97 20.232.890,20 200.439.199,31	(27,0464) (31,6400) (30,4300) (31,7100) (31,2266) (30,6200) (29,4600)	8,3895 14,5500 11,3900 16,5000 17,4287 10,9400 6,0800	7,4818 6,1800 8,4600 10,2769 7,5516 9,1800 5,8200	TRIMESTRE -15,0098% -16,8543% -15,9500% -12,2661% -13,1416% -15,9640% -20,8161%	2020 -23,7408% -22,1952% -23,0344% -16,8652% -19,2263% -24,2100% -25,9026%	VLTIMOS 12 MESES NC NC NC NC 3,4691% 12,2036% NC -8,7414%
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA BRADESCO FIA MID SMALL CAPS BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPH BTG ABSOLUTO FIQ FIA CAIXA CONSUMO FI AÇÕES ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ R\$ R\$ R\$ R\$ R\$ R\$	\$ALI 30/04/2020 70.321.147,48 95.825.263,28 23.540.406,36 164.284.868,53 71.920.135,47 18.531.869,22 189.416.121,53 122.301.770,19	R\$ R\$ R\$ R\$ R\$ R\$ R\$	29/05/2020 75.582.464,84 101.746.750,51 25.530.907,62 181.168.220,48 77.351.283,97 20.232.890,20 200.439.199,31 125.856.146,61	(27,0464) (31,6400) (30,4300) (31,7100) (31,2266) (30,6200) (29,4600) (32,3400)	8,3895 14,5500 11,3900 16,5000 17,4287 10,9400 6,0800 11,0300	7,4818 6,1800 8,4600 10,2769 7,5516 9,1800 5,8200 5,3600	-15,0098% -16,8543% -15,9500% -12,2661% -13,1416% -15,9640% -20,8161% -20,8505%	2020 -23,7408% -22,1952% -23,0344% -16,8652% -19,2263% -24,2100% -25,9026% -28,7361%	ULTIMOS 12 MESES NC NC NC 3,4691% 12,2036% NC -8,7414% -6,0573%
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA BRADESCO FIA MID SMALL CAPS BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPH BTG ABSOLUTO FIQ FIA CAIXA CONSUMO FI AÇÕES ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ R\$ R\$ R\$ R\$ R\$ R\$ R\$	\$ALI 30/04/2020 70.321.147,48 95.825.263,28 23.540.406,36 164.284.868,53 71.920.135,47 18.531.869,22 189.416.121,53 122.301.770,19 7.426.780,88	R\$ R\$ R\$ R\$ R\$ R\$ R\$ R\$ R\$	29/05/2020 75.582.464,84 101.746.750,51 25.530.907,62 181.168.220,48 77.351.283,97 20.232.890,20 200.439.199,31 125.856.146,61 8.016.229,65	(27,0464) (31,6400) (30,4300) (31,7100) (31,2266) (30,6200) (29,4600) (32,3400) (31,3400)	8,3895 14,5500 11,3900 16,5000 17,4287 10,9400 6,0800 11,5700	7,4818 6,1800 8,4600 10,2769 7,5516 9,1800 5,8200 5,3600 7,9400	-15,0098% -16,8543% -15,9500% -12,2661% -13,1416% -15,9640% -20,8161% -20,8505% -17,3137%	2020 -23,7408% -22,1952% -23,0344% -16,8652% -19,2263% -24,2100% -25,9026% -28,7361% -23,2279%	ULTIMOS 12 MESES NC NC NC NC 3,4691% 12,2036% NC -8,7414% -6,0573% -5,2288%
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA BRADESCO FIA MID SMALL CAPS BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPH BTG ABSOLUTO FIQ FIA CAIXA CONSUMO FI AÇÕES ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ R\$ R\$ R\$ R\$ R\$ R\$ R\$ R\$	\$ALI 30/04/2020 70.321.147,48 95.825.263,28 23.540.406,36 164.284.868,53 71.920.135,47 18.531.869,22 189.416.121,53 122.301.770,19 7.426.780,88 94.688.731,95	R\$	29/05/2020 75.582.464,84 101.746.750,51 25.530.907,62 181.168.220,48 77.351.283,97 20.232.890,20 200.439.199,31 125.856.146,61 8.016.229,65 103.382.797,92	(27,0464) (31,6400) (30,4300) (31,7100) (31,2266) (30,6200) (29,4600) (32,3400) (31,3400) (41,8800)	8,3895 14,5500 11,3900 16,5000 17,4287 10,9400 6,0800 11,0300 11,5700 9,1700	7,4818 6,1800 8,4600 10,2769 7,5516 9,1800 5,8200 5,3600 7,9400 9,1800	TRIMESTRE -15,0098% -16,8543% -15,9500% -12,2661% -13,1416% -20,8161% -20,8505% -17,3137% -30,7257%	2020 -23,7408% -22,1952% -23,0344% -16,8652% -19,2263% -24,2100% -25,9026% -28,7361% -23,2279% -36,2226%	ULTIMOS 12 MESES NC NC NC 3,4691% 12,2036% NC -8,7414% -6,0573% -5,2288%
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA BRADESCO FIA MID SMALL CAPS BRADESCO FIC FIA INSTITI IBRX ALPH BTG ABSOLUTO FIQ FIA CAIXA CONSUMO FI AÇÕES ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI ITAU SMALL CAPS VALUATION	R\$	\$ALI 30/04/2020 70.321.147,48 95.825.263,28 23.540.406,36 164.284.868,53 71.920.135,47 18.531.869,22 189.416.121,53 122.301.770,19 7.426.780,88 94.688.731,95 37.928.799,42	R\$ R	29/05/2020 75.582.464,84 101.746.750,51 25.530.907,62 181.168.220,48 77.351.283,97 20.232.890,20 200.439.199,31 125.856.146,61 8.016.229,65 103.382.797,92 39.657.050,35	(27,0464) (31,6400) (30,4300) (31,7100) (31,2266) (30,6200) (29,4600) (32,3400) (31,3400) (41,8800) (34,8100)	8,3895 14,5500 11,3900 16,5000 17,4287 10,9400 6,0800 11,0300 11,5700 9,1700	7,4818 6,1800 8,4600 10,2769 7,5516 9,1800 5,8200 7,9400 9,1800 4,5600	-15,0098% -16,8543% -15,9500% -12,2661% -13,1416% -15,9640% -20,8161% -20,8505% -17,3137% -30,7257% -24,4281%	2020 -23,7408% -22,1952% -23,0344% -16,8652% -19,2263% -24,2100% -25,9026% -28,7361% -23,2279% -36,2226% -33,9082%	ULTIMOS 12 MESES NC NC NC NC 12,2036% NC -8,7414% -6,0573% -5,2288% -18,7143% NC
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA BRADESCO FIA MID SMALL CAPS BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPH BTG ABSOLUTO FIQ FIA CAIXA CONSUMO FI AÇÕES ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI ITAU SMALL CAPS VALUATION SAFRA S&P REAIS	R\$	\$ALI 30/04/2020 70.321.147,48 95.825.263,28 23.540.406,36 164.284.868,53 71.920.135,47 18.531.869,22 189.416.121,53 122.301.770,19 7.426.780,88 94.688.731,95 37.928.799,42 17.062.822,72	R\$	29/05/2020 75.582.464,84 101.746.750,51 25.530.907,62 181.168.220,48 77.351.283,97 20.232.890,20 200.439.199,31 125.856.146,61 8.016.229,65 103.382.797,92 39.657.050,35 17.947.326,74	(27,0464) (31,6400) (30,4300) (31,7100) (31,2266) (30,6200) (29,4600) (32,3400) (31,3400) (41,8800) (34,8100) (14,5600)	8,3895 14,5500 11,3900 16,5000 17,4287 10,9400 6,0800 11,5700 9,1700 10,8700 11,7100	7,4818 6,1800 8,4600 10,2769 7,5516 9,1800 5,8200 5,3600 7,9400 9,1800 4,5600 5,1838	-15,0098% -16,8543% -15,9500% -12,2661% -13,1416% -15,9640% -20,8161% -20,8505% -17,3137% -30,7257% -24,4281% 0,3927%	2020 -23,7408% -22,1952% -23,0344% -16,8652% -19,2263% -24,2100% -25,9026% -28,7361% -23,2279% -36,2226% -33,9082% -6,7347%	ULTIMOS 12 MESES NC NC NC 3,4691% 12,2036% NC -8,7414% -6,0573% -5,2288% -18,7143% NC 10,9591%
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA BRADESCO FIA MID SMALL CAPS BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPH BTG ABSOLUTO FIQ FIA CAIXA CONSUMO FI AÇÕES ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI ITAU SMALL CAPS VALUATION SAFRA S&P REAIS SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES	RS	\$ALI 30/04/2020 70.321.147,48 95.825.263,28 23.540.406,36 164.284.868,53 71.920.135,47 18.531.869,22 189.416.121,53 122.301.770,19 7.426.780,88 94.688.731,95 37.928.799,42 17.062.822,72 51.445.200,86	R\$	29/05/2020 75.582.464,84 101.746.750,51 25.530.907,62 181.168.220,48 77.351.283,97 20.232.890,20 200.439.199,31 125.856.146,61 8.016.229,65 103.382.797,92 39.657.050,35 17.947.326,74 54.540.144,54	(27,0464) (31,6400) (30,4300) (31,7100) (31,2266) (30,6200) (29,4600) (32,3400) (41,8800) (34,8100) (14,5600) (33,4769)	8,3895 14,5500 11,3900 16,5000 17,4287 10,9400 6,0800 11,0300 9,1700 10,8700 11,7100 11,0000	7,4818 6,1800 8,4600 10,2769 7,5516 9,1800 5,8200 7,9400 9,1800 4,5600 5,1838 6,0160	-15,0098% -16,8543% -15,9500% -12,2661% -13,1416% -15,9640% -20,8161% -20,8505% -17,3137% -30,7257% -24,4281% 0,3927% -21,7171%	2020 -23,7408% -22,1952% -23,0344% -16,8652% -19,2263% -24,2100% -25,9026% -28,7361% -23,2279% -36,2226% -33,9082% -6,7347% -29,3786%	ULTIMOS 12 MESES NC NC NC 3,4691% 12,2036% NC -8,7414% -6,0573% -5,2288% NC 18,7143% NC 10,9591% -14,7128%

TOTAL GERAL R\$ 4.043.876.928,56 R\$ 4.096.995.276,52

R\$

R\$

R\$

R\$

Quadro 1.

OCCAM FIC FIA

AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA

SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES

TOTAL RENDA VARIÁVEL

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.

15.000.000,00

15.000.000,00

15.000.000,00

R\$

R\$

1.073.410.146,87 R\$ 1.213.323.880,69

0,0000%

0,0000%

0,0000%

0,0000%

0,0000%

0,0000%

NC

Nota 2: Os novos recursos foram direcionados para o fundo Caixa Gestão Estratégica, conforma autorização com base na ATA COMIV 161/2020. Com base na Ata COMIV 162/2020, a Diretoria Deferiu as sugestões para migrar recursos para os fundos: Safra Consumo Americano, OCCAM FIC FIA, AZ Quest Small FIC FIA e Sulamérica Equities FIA, sendo o valor total migrado a partir do fundo BB Previdenciário Alocação Ativa FIC FI RF;

Nota 3: Conforme Parecer nº. 1133/2020-COMIV, registra-se que para o desinvestimento das aplicações, visando cumprir os termos da LC 206/2020 - FTEMP, foram utilizados todos os recursos aplicados no fundo Bradesco DI Premium. Para os próximos meses, serão utilizados os recursos dos fundos Bradesco IMA B5 e Santander Renda Fixa Ativo;

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		mar/20		abr/20		mai/20
BRADESCO	R\$	436.700.645,39	R\$	354.460.080,03	R\$	265.695.140,35
BANCO DO BRASIL	R\$	975.127.186,02	R\$	990.338.890,71	R\$	947.235.106,58
CAIXA	R\$	1.202.871.956,94	R\$	1.261.154.846,08	R\$	1.318.540.055,77
ITAÚ	R\$	474.429.580,41	R\$	499.357.817,15	R\$	515.204.940,53
SANTANDER	R\$	236.953.116,99	R\$	253.416.037,89	R\$	264.926.025,40
ICATU/BEM DTVM	R\$	371.338.369,79	R\$	388.401.230,82	R\$	403.839.772,12
SAFRA	R\$	128.672.337,02	R\$	132.463.157,35	R\$	155.386.015,29
BTG PACTUAL	R\$	141.018.564,82	R\$	164.284.868,53	R\$	181.168.220,48
AZ QUEST	R\$	-	R\$	-	R\$	15.000.000,00
OCCAM BRASIL	R\$	-	R\$	-	R\$	15.000.000,00
SULAMÉRICA	R\$	-	R\$	-	R\$	15.000.000,00
TOTAL	R\$	3.967.111.757,38	R\$	4.043.876.928,56	R\$	4.096.995.276,52

Quadro 2.

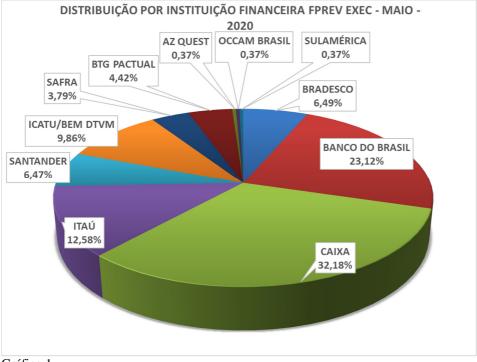


Gráfico 1

2.3 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA – FPREV EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	ÍNDICE DE REFERÊNCIA	SA	LDO APLICADO	% APLICADO
BRADESCO FI REFER DI PREMIUM	CDI	R\$	705.670,29	0,02%
BRADESCO FI MAXI PODER PUBLICO	CDI	Kφ	705.070,29	0,02%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA				
BB PREVID ALOCAÇÃO ATIVA				
SAFRA S&P REAIS	CDI ATIVO	R\$	1.613.741.926,13	39,39%
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	CDIATIVO	КФ	1.013.741.920,13	39,3970
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI				
SANTANDER RF ATIVO FIC				
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	IMA B	R\$	117.246.825,36	2,86%
SANTANDER IMA B INST. TP	IIVIA D	КÞ	117.240.823,30	2,80%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP				
ICATU VANG. FI RF INFLA. CP	IMA B 5	R\$	787.231.354,60	19,21%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF				
SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF				
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	DAA DE	D¢	266 917 446 19	(510)
BB PREVID RF IMA B5+	IMA B5+	R\$	266.817.446,18	6,51%
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF				
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	IPCA + 6%	R\$	115.875.500,01	2,83%
BB PREVID TP VII				
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	IDD V	D.C	45 762 707 02	1 120
ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI	IBR X	R\$	45.763.797,82	1,12%
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA				
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS				
ITAU SMALL CAPS VALUATION				
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC				
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA				
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	IBOVESPA	R\$	1.129.420.892,94	27,57%
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				
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	BDR NIVEL I	R\$	20.191.863,19	0,49%
TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO		R\$	4.096.995.276,52	100%

Quadro 3.



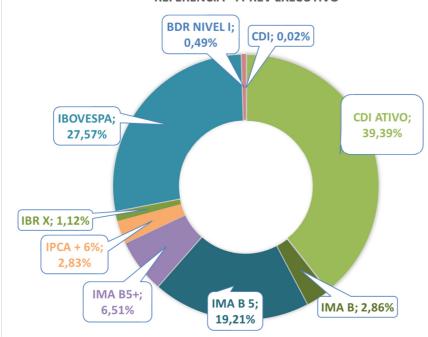


Gráfico 2.

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA -	SAL	SALDO			VALORIZAÇÃO (%)						
DATA DO VENCIMENTO)	31/03/2020	30/04/2020	fev/20	mar/20	abr/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES			
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 155.734.727,56	R\$ 156.066.395,60	0,7759	0,5950	0,2130	1,591%	2,3388%	9,0345%			
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 157.711.840,37	R\$ 158.062.529,64	0,7854	0,6044	0,2224	1,620%	2,3772%	9,1572%			
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 161.144.191,51	R\$ 161.540.365,29	0,8090	0,6280	0,2459	1,691%	2,4732%	9,4646%			
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 163.451.350,51	R\$ 163.814.827,81	0,7854	0,6044	0,2224	1,620%	2,3772%	9,1574%			
TOTAL GERAL	R\$ 638.042.109,95	R\$ 639.484.118,34									

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

2.0 CHILLETEING FOR THE EGG TEBELLING								
SEGMENTO		Renda Fixa		Renda Fixa		Renda Fixa	Renda Fixa	
TIPO DE ATIVO		NTN B	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\$	156.066.395,60	R\$	158.062.529,64	R\$	161.540.365,29	R\$	163.814.827,81
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

DECCRICÃO.	SALDO						
DESCRIÇÃO	30	0/04/2020	29/05/2020				
CVS - A	R\$	1.397.079,34	R\$	1.379.626,02			
CVS - B	R\$	9.039.824,90	R\$	8.926.847,10			
CVS - C	R\$	181.231,96	R\$	178.967,88			
CVS - D	R\$	991.337,16	R\$	978.947,64			
TOTAL	R\$	11.609.473,36	R\$	11.464.388,64			

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.

2.8 CVS - REPASSE FINANCEIRO

MÊS		JUROS	PF	RINCIPAL	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	
TOTAL	R\$	172.234,08	R\$	725.423,60	R\$	897.657,68	

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			
TOTAL	R\$	116.361,92	R\$	602.186,40	R\$	718.548,32			

Quadro 8.

2.10 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

		SA			
RECURSOS FPREV EXECUTIVO		31/03/2020		30/04/2020	% dos Recursos
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$	3.967.111.757,38	R\$	4.043.876.928,56	85,0389%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$	638.042.109,95	R\$	639.484.118,34	13,4478%
TÍTULOS CVS	R\$	11.754.558,08	R\$	11.609.473,36	0,2441%
IMÓVEIS	R\$	60.353.005,55	R\$	60.353.005,55	1,2692%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$	604.694,26	R\$	601,00	0,0000%
TOTAL	R\$	4.677.866.125,22	R\$	4.755.324.126,81	100,00%

Quadro 9.

2.11 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

Mês	Recursos FPREV	Evolução					
Wits	Executivo	Mensal	Anual	12 Meses			
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%	25,83%			
fev/20	R\$ 5.147.828.344,11	-1,30%	-0,51%	22,61%			
mar/20	R\$ 4.677.866.125,22	-9,13%	-9,59%	9,54%			
abr/20	R\$ 4.755.324.126,81	1,66%	-8,09%	9,55%			

Quadro 10.

2.12 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Município de Governo Amazonas / AM - EXECUTIVO2020

08/05/2020 12:24:54

Fundo Prev	idenciário	Cálculo Posicionad	o em 30/04/2020
	Saldo Fina	anceiro em 30/04/2019	4.340.813.251,38
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
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
03/2020	44.294.358,68	12.998.534,20	31.295.824,48
04/2020	41.873.777,81	12.578.581,62	29.295.196,19
	Saldo Fina	anceiro em 30/04/2020	4.755.324.126.81

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	2,3990%	0,2192 %	-0,3100%
Juros	5,8800%	1,9228 %	0,4773 %
Meta	8,4201 %	2,1462 %	0,1658 %
Rentabilidade %	-1,4688%	-10,5813 %	1,0296 %
Rentabilidade R\$	-67.016.539,03	-553.113.958,86	48.162.805,40
Resultado %	-9,1209%	-12,4601 %	+0,8624 %
Resultado R\$	-450.856.581,37	-665.270.434,71	+40.407.337,76

Quadro 11.

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

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO- FPREV ALE

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

11 Switters, 2 is promising with the control with the con								,		
		SAI	SALDOS			VALORIZAÇÃO				
FUNDO DE INVESTIMENTO	30/04/2020			29/05/2020	mar/20	abr/20	mai/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$	4.852.803,58	R\$	4.919.710,44	(0,1306)	1,1112	1,3787	2,3713%	3,8469%	11,9840%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$	4.778.330,14	R\$	4.804.155,66	0,5300	0,1400	0,5400	1,2144%	1,8209%	NC
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$	548.704,44	R\$	560.729,12	(4,4100)	0,6200	2,1900	-1,7109%	-0,2011%	NC
TOTAL RENDA FIXA	R\$	10 179 838 16	R\$	10 284 595 22				•		

		SALDOS				VALORIZAÇÃO				
FUNDO DE INVESTIMENTO	30/04/2020			29/05/2020	mar/20	abr/20	mai/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$	417.955,58	R\$	442.278,52	(29,4600)	6,0800	5,8200	-20,8161%	-25,9026%	NC
CAIXA FIA CONSUMO	R\$	176.818,25	R\$	190.170,92	(31,2266)	17,4287	7,5516	-13,1416%	-23,9317%	NC
OCCAM FIC FIA	R\$	-	R\$	59.749,24	-	-	8,2900	8,2900%	8,2900%	NC
SAFRA CONSUMO AMERICANO	R\$	-	R\$	59.738,78	-	-	-	0,0000%	0,0000%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$	594.773,83	R\$	751.937,46				-		

R\$ 10.774.611,99 R\$ 11.036.532,68

Quadro 12.

TOTAL GERAL

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos -ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA	SAI	LDO	VALORIZAÇÃO (%)					
DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	31/03/2020	30/04/2020	fe v/20	mar/20	abr/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.153.666,97	R\$ 2.158.455,88	0,785351	0,604390	0,222361	1,6199%	2,3772%	9,1572%
TOTAL GERAL	R\$ 2.153.666,97	R\$ 2.158.455,88						

Quadro 13.

3.3 Composição dos Recursos - ALE/FPREV

ete composição dos micrars			
RECURSOS - ALE FPREV	fev/20	mar/20	abr/20
SALDO ANTERIOR	12.693.470,59	12.745.197,26	12.694.389,88
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	116.166,02	116.289,97	119.283,88
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	(64.439,35)	(167.097,35)	119.394,11
SAÍDAS FINANCEIRAS	-	-	-
SALDO FINAL	12.745.197,26	12.694.389,88	12.933.067,87

Quadro 14

3.4 Total dos Recursos – ALE/FPREV

DECLIDEDE ALE EDDEV		SALDO						
RECURSOS ALE FPREV		31/03/2020		30/04/2020				
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$	10.540.722,91	R\$	10.774.611,99				
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$	2.153.666,97	R\$	2.158.455,88				
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$	-	R\$	_				
TOTAL	R\$	12.694.389,88	R\$	12.933.067,87				

Quadro 15.

3.5 Evolução dos Recursos - ALE/FPREV

Mês	R	ecursos ALE		Evolução	
Mes		FPREV	Mensal	Anual	12 Meses
abr/19	R\$	11.181.920,91	7,81%	15,87%	35,97%
mai/19	R\$	10.907.257,42	-2,46%	13,02%	33,82%
jun/19	R\$	11.207.199,38	2,75%	16,13%	35,83%
jul/19	R\$	11.373.542,16	1,48%	17,85%	33,46%
ago/19	R\$	11.456.007,59	0,73%	18,71%	32,37%
set/19	R\$	11.774.465,04	2,78%	22,01%	30,94%
out/19	R\$	12.017.646,25	2,07%	24,53%	33,35%
nov/19	R\$	12.150.767,48	1,11%	25,91%	32,09%
dez/19	R\$	12.391.075,09	1,98%	28,40%	28,40%
jan/20	R\$	12.693.470,60	2,44%	2,44%	26,47%
fev/20	R\$	12.745.197,26	0,41%	2,86%	24,93%
mar/20	R\$	12.694.389,88	-0,40%	2,45%	22,39%
abr/20	R\$	12.933.067,87	1,88%	4,37%	15,66%

Quadro 16.

3.6 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Município de Governo Amazonas / AM - ASSEMBLEIA2020 08/05/2020 12:20:23

Fundo Previ	denciário	Cálculo Posicionado	em 30/04/2020
	Saldo Fina	anceiro em 30/04/2019	10.586.213,41
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
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
03/2020	116.289,97	0,00	116.289,97
04/2020	119.283,88	0,00	119.283,88
	Saldo Fina	nceiro em 30/04/2020	12.933.067,87

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	2,3990%	0,2192 %	-0,3100 %
Juros	5,8800%	1,9228 %	0,4773 %
Meta	8,4201%	2,1462 %	0,1658 %
Rentabilidade %	8,5235%	-0,3322 %	0,9405 %
Rentabilidade R\$	950.858,02	-42.033,49	119.394,11
Resultado %	+0,0954%	-2,4263 %	+0,7735 %
Resultado R\$	+11.525,51	-313.559,80	+98.347,99

Quadro 17.

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

4. RECURSOS DO MPE - FPREV

TOTAL

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

R\$ 148.571.836,16 R\$ 151.689.775,95

		SALDOS				VALORIZAÇÃO (%)				
FUNDO DE INVESTIMENTO	30/04/2020			29/05/2020	mar/20	abr/20	mai/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$	54.381.348,58	R\$	56.480.685,30	(2,1100)	1,0200	1,1200	-0,0040%	0,8150%	NC
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$	94.190.487,58	R\$	95.200.345,30	(2,1012)	0,9125	1,0721	-0,1487%	0,6927%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$	-	R\$	8.745,35						

Quadro 18.

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial - MPE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Município de Governo Amazonas / AM - PGJMP2020 08/05/2020 12:27:29

Fundo Prev	denciário/	Cálculo Posicionado	em 30/04/2020
	Saldo Fina	nceiro em 30/04/2019	101.445.311,61
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
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
03/2020	1.275.904,25	22.438,21	1.253.466,04
04/2020	1.268.670,97	10.639,28	1.258.031,69
	Saldo Fina	nceiro em 30/04/2020	148.571.836.16

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	2,3990%	0,2192 %	-0,3100 %
Juros	5,8800%	1,9228 %	0,4773 %
Meta	8,4201 %	2,1462 %	0,1658 %
Rentabilidade %	6,5138%	-0,3955 %	0,9593 %
Rentabilidade R\$	8.075.267,78	-575.612,67	1.399.748,21
Resultado %	-1,7583%	-2,4883 %	+0,7922 %
Resultado R\$	-2.357.830,28	-3.698.861,73	+1.157.836,25

Quadro 19.

5. RECURSOS DO DPE - FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO		SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)					
		30/04/2020		29/05/2020	mar/20	abr/20	mai/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$	9.185.262,01	R\$	9.383.931,93	(1,7800)	0,5500	2,1600	0,8934%	2,1160%	NC
BRADESCO INST. ALOC. DINAMICA	R\$	5.704.439,23	R\$	6.736.509,99	(2,1100)	1,0200	1,1200	-0,0040%	0,8165%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE		-		-						
TOTAL	R\$	14 889 701 24	R\$	16 120 441 92						

Quadro 20.

5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Município de Governo Amazonas / AM - DEFENSORIA2020 08/05/2020 12:22:51

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado	em 30/04/2020			
	Saldo Financeiro em 30/04/2019					
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$			
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			
03/2020	810.969,00	0,00	810.969,00			
04/2020	818.197,74	0,00	818.197,74			
	Saldo Fin	anceiro em 30/04/2020	14.889.701.24			

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	2,3990%	0,2192 %	-0,3100%
Juros	5,8800%	1,9228 %	0,4773 %
Meta	8,4201 %	2,1462 %	0,1658 %
Rentabilidade %	5,4366%	-0,0826 %	0,7304 %
Rentabilidade R\$	473.591,84	-10.789,17	102.039,78
Resultado %	-2,7518%	-2,1819 %	+0,5637 %
Resultado R\$	-257.848,10	-291.144,80	+78.879,71

Quadro 21.

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

6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO		SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)					
		30/04/2020		29/05/2020	mar/20	abr/20	mai/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$	30.661.000,77	R\$	36.248.316,13	(1,7800)	0,5500	2,1600	0,8934%	2,1160%	NC
BRADESCO ALOCAÇÃO DINAMICA RF	R\$	1.385.671,79	R\$	1.401.236,07	(2,1100)	1,0200	1,1200	-0,0040%	0,3860%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$	-	R\$	35.772,26						
TOTAL	R\$	32.046.672,56	R\$	37.685.324,46						

Quadro 22.

6.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Município de Governo Amazonas / AM - TRIBUNALJUSTICA2020

08/05/2020 12:31:45

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado	em 30/04/2020
	Saldo Fina	anceiro em 30/04/2019	2.253.391,85
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
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
03/2020	2.647.202,34	269.053,00	2.378.149,34
04/2020	3.365.431,19	1.946.519,39	1.418.911,80
	Saldo Fina	nceiro em 30/04/2020	32.046.672,56

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	2,3990%	0,2192 %	-0,3100 %
Juros	5,8800%	1,9228 %	0,4773 %
Meta	8,4201%	2,1462 %	0,1658 %
Rentabilidade %	13,1905%	6,1610 %	6,0878 %
Rentabilidade R\$	1.854.002,57	1.572.459,78	1.757.546,56
Resultado %	+4,3999%	+3,9305 %	+5,9122 %
Resultado R\$	+661.248,03	+1.024.093,71	+1.709.682,43

Quadro 23.

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

7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

	SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)						
FUNDO DE INVESTIMENTO		30/04/2020	**	29/05/2020	mar/20	abr/20	mai/20	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$	5.650.926,46	R\$	5.773.151,53	(1,7800)	0,5500	2,1600	0,8934%	2,1160%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$	-	R\$	-						
TOTAL	R\$	5.650.926,46	R\$	5.773.151,53						

Quadro 24.

7.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Município de Governo Amazonas / AM - TRIBUNALCONTAS2020

08/05/2020 12:29:35

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado	em 30/04/2020				
	Saldo Financeiro em 30/04/2019						
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$				
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				
03/2020	245.127,45	0,00	245.127,45				
04/2020	770,472,25	0,00	770.472,25				
	Saldo Fin	anceiro em 30/04/2020	5.650.926,46				

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	2,3990%	0,2192 %	-0,3100 %
Juros	5,8800%	1,9228 %	0,4773 %
Meta	8,4201%	2,1462 %	0,1658 %
Rentabilidade %	3,1606%	-0,3147 %	0,5140 %
Rentabilidade R\$	70.727,93	-13.574,61	24.955,81
Resultado %	-4,8510%	-2,4092 %	+0,3476 %
Resultado R\$	-115.684,70	-106.078,18	+16.905,84

Quadro 25.

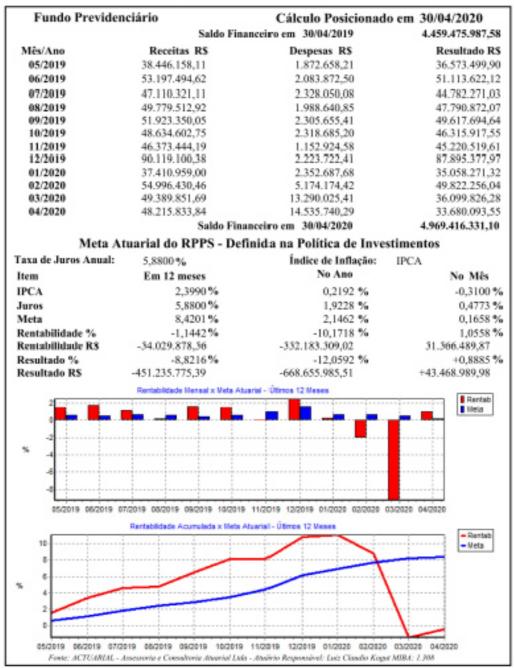
Nota: Os valores de **Receita** referem-se às contribuições previdenciárias recebidas no período. Os valores de **Despesas** referem-se ao pagamento de inativos e pensionistas.

8. CONSOLIDADO - FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Municipio de Governo Amazonas / AM - CALCULOATUARIAL2020 08/05/2020 12:35:28



Quadro 26.

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

9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN - Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS						
DESCRIÇÃO		30/04/2020	29/05/2020				
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$	1.728.850,03	R\$	43.403.397,55			
FUNDO BRADESCO FIC FI RF ALOC. DINÂMICA - COMPREV	R\$	4.435.497,03	R\$	4.571.651,50			
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$	0,02	R\$	0,02			
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$	34.865,65	R\$	34.865,65			
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$	124.313,89	R\$	116.690,14			
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$	1,00	R\$	-			
TOTAL	R\$	6.323.527,62	R\$	48.126.604,86			

Quadro 27.

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

Nota 2: Os valores de Disponibilidade Financeira (saldo em conta corrente) referem-se ao crédito de recursos após o horário permitido para aplicação.

9.2 Fundo Temporário - FTEMP

DESCRIÇÃO		SALDOS						
		30/04/2020		29/05/2020				
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$	11.124.407,46	R\$	12.056.275,51				
TOTAL	R\$	11.124.407,46	R\$	12.056.275,51				

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. O valor de disponibilidade financeira em conta corrente refere-se à valores de Consignação em processo de pagamento, regularizado em junho/2020.

9.3 FFIN Defensoria Pública - DPE/AM

DESCRIÇÃO	SALDOS							
DESCRIÇÃO	30/04/2020	29/05/2020						
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ -	R\$ -						

Ouadro 29.

Nota 1: Os valores recebidos de Contribuição foram devidamente utilizados no pagamento das folhas de aposentados e pensionistas desse órgão.

9.3 FFIN Assembleia - ALE/AM

2.5 I I II / /ISSEMBICIA / / / / / / / / / / / / / / / / / / /								
ELINIDO DE INIVESSIMA ENSSO	SALDOS							
FUNDO DE INVESTIMENTO		30/04/2020		29/05/2020				
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$	219.398,00	R\$	390.718,59				
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$	45.704,78	R\$	584.529,47				
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$	1,00	R\$	37.829,74				
TOTAL	R\$	265.103,78	R\$	1.013.077,80				

Quadro 30.

9.4 Composição do Recursos – ALE FFIN

DESCRIÇÃO		fev/20		mar/20		abr/20
SALDO ANTERIOR	R\$	822.821,15	R\$	441.964,73	R\$	1.042.360,78
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	R\$	892.857,48	R\$	1.009.727,34	R\$	1.046.162,16
COBERTURA DO DEFICIT	R\$	972.432,33	R\$	2.461.687,45	R\$	1.577.548,74
VARIAÇÃO FINANCEIRA	-R\$	12.856,11	R\$	421,28	R\$	1.182,85
(-) SAIDAS FINANCEIRAS	-R\$	2.233.711,40	-R\$	2.872.622,87	-R\$	3.402.150,75
SALDO FINAL	R\$	441.964,73	R\$	1.042.360,78	R\$	265.103,78

Quadro 31.

9.5 FFIN - Procuradoria Geral - PGJ / MPE

200 1111 110 curuudina Gerar 1 Gg / Wil E											
THE PORT OF THE PROPERTY OF THE PORT OF TH	SALDOS										
FUNDO DE INVESTIMENTO	3	0/04/2020		29/05/2020							
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$	766.314,15	R\$	779.395,22							
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$	182.655,11	R\$	188.668,37							
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$	-	R\$	1,00							
TOTAL	R\$	948.969,26	R\$	968.064,59							

Quadro 32.

9.6 Composição do Recursos - PGJ / MPE

DESCRIÇÃO		fev/20		mar/20		abr/20
SALDO ANTERIOR	R\$	43.889,00	R\$	963.206,06	R\$	966.929,21
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	R\$	2.288.213,60	R\$	2.283.915,49	R\$	2.915.577,04
COBERTURA DO DEFICIT	R\$	1.372.826,11	R\$	1.337.967,07	R\$	619.217,74
VARIAÇÃO FINANCEIRA	R\$	905.081,79	-R\$	377.361,05	R\$	189.887,45
(-) SAIDAS FINANCEIRAS	-R\$	3.269.443,39	-R\$	3.430.685,81	-R\$	3.742.642,18
SALDO FINAL	R\$	963.206,06	R\$	966.929,21	R\$	948.969,26

Quadro 33.

10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

1011 Tuku de Hammistração EMECETIVO												
		SALDOS				VALORIZAÇÃO (%)						
FUNDO DE INVESTIMENTO		30/04/2020		29/05/2020	mar/20	abr/20	mai/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES		
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$	2.721.044,38	R\$	2.290.904,65	0,3100	0,2500	0,2200	0,7820%	1,4033%	4,5637%		
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$	40.381.219,06	R\$	40.937.965,27	(0,1306)	1,1112	1,3787	2,3713%	3,8469%	9,4503%		
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$	1,00	R\$	1,00								
TOTAL	R\$	43.102.264,44	R\$	43.228.870,92								

Quadro 34.

10.2 Taxa de Administração - ALE

		SALDOS				VALORIZAÇÃO (%)						
FUNDO DE INVESTIMENTO	3	30/04/2020		29/05/2020	mar/20	abr/20	mai/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES		
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$	1.015.723,93	R\$	1.052.229,34	0,3100	0,2500	0,2200	0,7820%	1,4033%	4,5636%		
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$	-	R\$	-								
TOTAL	DΦ	1.015.732.02	DΦ	1 052 220 24	,							

Quadro 35.

10.3 Taxa de Administração - TCE

		SALDOS				VALORIZAÇÃO (%)						
FUNDO DE INVESTIMENTO	30	/04/2020	29	0/05/2020	mar/20	abr/20	mai/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES		
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$	578.078,54	R\$	629.596,22	0,3100	0,2500	0,2200	0,7820%	1,4033%	2,5863%		
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$	-	R\$	-								
TOTAL	R\$	578.078,54	R\$	629.596,22								

Quadro 36.

10.3 Taxa de Administração - TJ/AM

		SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)						
FUNDO DE INVESTIMENTO	3	30/04/2020	1	29/05/2020	mar/20	abr/20	mai/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$	1.549.464,50	R\$	1.702.172,20	0,3100	0,2500	0,2200	0,7820%	1,4033%	1,8657%	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$	-	R\$	-				•		•	
TOTAL	R\$	1.549.464,50	R\$	1.702.172,20							

Quadro 37.

11. OUTROS RECURSOS

11.1 Tribunal de Justiça do Estado - TJA

		SA		VALORIZAÇÃO						
FUNDO DE INVESTIMENTO	3	30/04/2020		29/05/2020		abr/20	mai/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$	7.871.687,20	R\$	4.070.767,12	0,3100	0,2500	0,2200	0,7820%	1,4032%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF M1 TP RF - TJA	R\$	189.443.986,79	R\$	190.188.531,80	0,5878	0,4332	0,3930	1,4206%	2,2191%	6,1125%
BB PREV. RF IRF M1 - TJA	R\$	134.691.211,38	R\$	135.214.784,10	0,5976	0,4123	0,3887	1,4050%	2,1897%	6,0419%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$	49.160.436,94	R\$	49.687.507,65	(2,1012)	0,9125	1,0721	-0,1487%	0,3065%	0,3065%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$	-	R\$	-						
TOTAL	R\$ 3	81.167.322.31	R\$	379.161.590.67						

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 déficit nesse momento.

11.2 Composição dos Saldos - TJA

TITE Composição dos sur	uob Igii		
FUNDO DE INVESTIMENTO	mar/20	abr/20	mai/20
SALDO ANTERIOR	380.395.289,26	375.838.977,07	381.167.322,31
CONTRIB. PREVIDENCIÁRIA	5.665.475,57	7.264.098,12	5.677.469,04
COBERTURA DO DEFICIT	-	8.613.175,86	4.415.066,44
VARIAÇÃO FINANCEIRA	878.636,51	5.613.220,90	(5.304.791,87)
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(11.100.424,27)	(10.857.357,77)	(6.793.475,25)
SALDO FINAL	R\$ 375.838.977,07	R\$ 381.167.322,31	R\$ 379.161.590,67

Quadro 39.

11.3 Tribunal de Contas do Estado - TCE

		SA		VALORIZAÇÃO						
FUNDO DE INVESTIMENTO	30/04/2020			29/05/2020		abr/20	mai/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$	10.065.415,00	R\$	6.984.355,23	0,3100	0,2500	0,2200	0,7820%	1,4032%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF M1 TP RF - TCE	R\$	74.491.298,46	R\$	74.784.061,11	0,5878	0,4332	0,3930	1,4206%	2,2191%	6,1125%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$	49.160.436,94	R\$	49.687.507,65	(2,1012)	0,9125	1,0721	-0,1487%	0,3065%	0,3065%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$	-	R\$	-						
TOTAL	R\$ 13	33.717.150,40	R\$	131.455.923,99						

Quadro 40.

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 déficit nesse momento.

11.4 Composição dos Saldos - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	mar/20	abr/20	mai/20
SALDO ANTERIOR	140.574.193,31	135.925.639,92	133.717.150,40
CONTRIB. PREVIDENCIÁRIA	1.426.689,38	2.522.739,79	1.736.280,05
VARIAÇÃO FINANCEIRA	(548.441,95)	796.488,25	873.200,39
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(5.526.800,82)	(5.527.717,56)	(4.870.706,85)
SALDO FINAL	R\$ 135.925.639,92	R\$ 133.717.150,40	R\$ 131.455.923,99

Quadro 41.

12. ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS

12.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA		TOTAL	% DA CARTEIRA		DE ALOCAÇÃO - 2020	Resolução CMN nº
·				LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	3.922/2010
TÍTULOS DO TN	R\$	641.642.574,22	11,74%	10%	100%	art. 7°, inciso I, "a"
TOTAL art. 7°, inciso I, "a"	R\$	641.642.574,22				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$	134.691.211,38				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$	19.195.307,82				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$	162.978.919,70				
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$	263.935.285,25				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$	617.091.668,27				
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$	43.271.050,93	38,16%	10%	100%	art. 7°, inciso I, "b"
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$	51.209.039,94				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$	522.896.974,11				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$	53.998.663,06				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$	101.213.326,64				
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$	115.400.334,63				
TOTAL art. 7°, inciso I, "b"	R\$	2.085.881.781,73				
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$	27.841.831,77				
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$	98.353.171,41				
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$	120.077.350,29				
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$	126.742.178,52	29,98%	30%	40%	art. 7°, inciso IV, "a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$	930.354.877,17				
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$	241.790.064,85				
SANTANDER RF ATIVO FIC FI	R\$	93.254.608,05				
TOTAL art. 7°, inciso IV, "a"	R\$	1.638.414.082,06				
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$	25.789.954,81	0,47%	5%	5%	art 7°, inciso VII, "b"
TOTAL art 7°, inciso VII, "b"	R\$	25.789.954,81				
TOTAL RENDA FIXA	R\$	4.391.728.392,82	80,35%			_

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL		TOTAL	% DA CARTEIRA		DE ALOCAÇÃO - 2020	Resolução CMN nº	
SEGMEN IO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIAVEL		IOIAL	% DA CARTEIRA	LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	3.922/2010	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$	23.540.406,36	0.77%	10%	30%	art 8°, inciso I, "a"	
ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI	R\$	18.531.869,22	0,1776	10 %	30 %	arto, neisor, a	
TOTAL art 8°, inciso I, "a"	R\$	42.072.275,58					
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$	7.426.780,88					
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$	95.825.263,28					
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$	70.321.147,48					
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$	72.096.953,72					
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$	94.688.731,95					
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$	122.301.770,19	10.576	200	30%	. 00 ' ' 17 " "	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$	37.928.799,42	18,57%	30%	30%	art. 8°, inciso II, "a"	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$	189.834.077,11					
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$	164.284.868,53					
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$	74.094.302,36					
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$	34.621.926,62					
SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$	51.445.200,86					
TOTAL art. 8°, inciso II, "a"	R\$	1.014.869.822,40					
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$	17.062.822,72	0.216	1%	3%	. 00	
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$	-	0,31%	1%	3%	art. 8°, inciso III	
TOTAL art. 8°, inciso III	R\$	17.062.822,72					
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$	1.074.004.920,70	19,65%				
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$	5.465.733.313,52	100,00%				

Quadro 42.

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO		TOTAL	% CARTEIRA	Resolução CMN
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$	124 601 211 29		nº 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$	134.691.211,38 19.195.307,82	2,43% 0,35%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$		······································	
		162.978.919,70	2,94%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$	930.354.877,17	16,80%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$	70.321.147,48	1,27%	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$	263.935.285,25	4,76%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$	617.091.668,27	11,14%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$	43.271.050,93	0,78%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$	51.209.039,94	0,92%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$	27.841.831,77	0,50%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$	98.353.171,41	1,78%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$	120.077.350,29	2,17%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$	126.742.178,52	2,29%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$	23.540.406,36	0,42%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$	95.825.263,28	1,73%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$	241.790.064,85	4,37%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$	522.896.974,11	9,44%	20%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$	7.426.780,88	0,13%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$	122.301.770,19	2,21%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$	37.928.799,42	0,68%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$	72.096.953,72	1,30%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$	94.688.731,95	1,71%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$	189.834.077,11	3,43%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$	25.789.954,81	0,47%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$	53.998.663,06	0,97%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$	101.213.326,64	1,83%	
ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI	R\$	18.531.869,22	0,33%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$	164.284.868,53	2,97%	
SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$	51.445.200,86	0,93%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$	74.094.302,36	1,34%	
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$	34.621.926,62	0,63%	
SANTANDER RF ATIVO FIC FI	R\$	93.254.608,05	1,68%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$	17.062.822,72	0,31%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$	115.400.334,63	2,08%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO	R\$	4.824.090.739,30		

Quadro 43.

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.

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

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14	то	TAL APLICADO		PATRIMÔNIO JIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL DO FUNDO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$	134.691.211,38	R\$	7.168.032.689,23	1,88%	
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	R\$	19.195.307,82	R\$	668.626.387,30	2,87%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$	162.978.919,70	R\$	1.959.264.029,83	8,32%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$	930.354.877,17	R\$	10.512.346.440,60	8,85%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$	70.321.147,48	R\$	659.703.695,70	10,66%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$	27.841.831,77	R\$	429.126.354,79	6,49%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$	98.353.171,41	R\$	4.060.176.085,06	2,42%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$	120.077.350,29	R\$	887.003.090,20	13,54%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$	126.742.178,52	R\$	1.194.562.049,15	10,61%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$	23.540.406,36	R\$	216.567.493,68	10,87%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$	95.825.263,28	R\$	1.742.936.358,49	5,50%	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$	263.935.285,25	R\$	10.765.141.210,50	2,45%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$	617.091.668,27	R\$	9.104.032.681,09	6,78%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$	43.271.050,93	R\$	253.351.612,75	17,08%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$	51.209.039,94	R\$	208.983.063,64	24,50%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$	522.896.974,11	R\$	11.368.843.034,79	4,60%	150
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$	72.096.953,72	R\$	614.558.658,46	11,73%	15%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$	241.790.064,85	R\$	5.079.848.328,78	4,76%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$	7.426.780,88	R\$	648.464.272,67	1,15%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$	94.688.731,95	R\$	1.465.473.198,75	6,46%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$	122.301.770,19	R\$	2.886.370.474,18	4,24%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$	37.928.799,42	R\$	1.055.123.874,49	3,59%	
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$	34.621.926,62	R\$	1.289.580.026,20	2,68%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$	51.445.200,86	R\$	492.702.661,97	10,44%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$	74.094.302,36	R\$	649.751.204,35	11,40%	
SANTANDER RF ATIVO FIC FI	R\$	93.254.608,05	R\$	871.769.858,12	10,70%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$	189.834.077,11	R\$	1.392.329.916,92	13,63%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$	53.998.663,06	R\$	550.543.002,22	9,81%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$	101.213.326,64	R\$	971.255.744,32	10,42%	
ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI	R\$	18.531.869,22	R\$	178.857.880,94	10,36%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$	115.400.334,63	R\$	1.513.391.577,90	7,63%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$	164.284.868,53	R\$	1.601.688.122,14	10,26%	
TOTAL	R\$	4.781.237.961,77				

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14, § 1°	то	TAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Resolução CMN nº 3.922/2010
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$	17.062.822,72	375.097.540,79	4,55%	5%
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$	25.789.954,81	537.999.931,36	4,79%	3%
TOTAL	R\$	42.852.777,53			
	•		-		
TOTAL	R\$	4.824.090.739,30			

Quadro 44.

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 § 1° 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. 7°, III e IV do art. 8° (ver Enquadramento 1);

Nota 3: Art. 14 § 3°. Em caso de os limites de que tratam o caput e o § 1° 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. 14° - A - Res. CMN 3922/10

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA MAR/2020) EM R\$ MI		A	PLICAÇÕES - MAZONPREV (ABRIL/2020)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB DTVM S.A	R\$	1.055.928,85	R\$	1.317.541.463,55	0,1248%	
ITAU UNIBANCO SA	R\$	724.353,25	R\$	504.136.147,29	0,0696%	
BRADESCO	R\$	516.493,34	R\$	492.380.201,63	0,0953%	
CAIXA	R\$	367.639,97	R\$	1.570.500.972,22	0,4272%	5%
BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	R\$	286.638,18	R\$	253.416.037,89	0,0884%	3%
BANCO BTG	R\$	112.603,53	R\$	164.284.868,53	0,1459%	
BANCO SAFRA	R\$	96.233,74	R\$	132.463.157,35	0,1376%	
ICATÚ VANGUARDA DTVM S/A	R\$	25.100,30	R\$	389.367.890,84	1,5512%	

Quadro 45.

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.

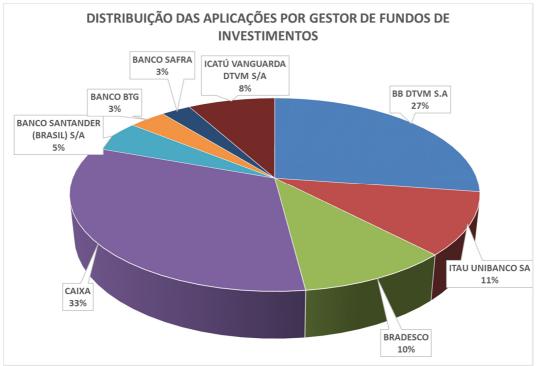


Gráfico 4.

13. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS - AMAZONPREV

FPREV PODER EXECUTIVO		SALDO
FUNDO DE INVESTIMENTO FPREV - EXECUTIVO	R\$	4.043.876.928,56
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$	639.484.118,34
TÍTULOS PÚBLICOS - CVS	R\$	11.609.473,36
IMÓVEIS	R\$	60.353.005,55
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EXECUTIVO	R\$	601,00
TOTAL	R\$	4.755.324.126,81

ASSEMBLEIA LEGISLATIVA		SALDO		
ALE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$	10.774.611,99		
ALE FPREV TÍTULOS PÚBLICOS	R\$	2.158.455,88		
ALE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$	-		
ALE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$	219.398,00		
ALE FFIN DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$	1,00		
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - ALE COBERTURA	R\$	45.704,78		
TOTAL	R\$	13.198.171,65		

PROCURADORIA GERAL DE JUSTIÇA - PGJ/MPE		SALDO
MPE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$	148.571.836,16
MPE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$	-
MPE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$	766.314,15
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - PGJ/MPE - FFIN	R\$	-
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - MPE COBERTURA	R\$	182.655,11
TOTAL	R\$	149.520.805,42

DFENSORIA PÚBLICA - DPE/AM		SALDO
DPE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$	14.889.701,24
DPE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$	-
DPE - FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$	=
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - DPE - FFIN	R\$	=
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - DPE COBERTURA	R\$	-
TOTAL	R\$	14.889.701,24

TRIBUNAL DE JUSTIÇA - TJ/AM		SALDO
TJ/AM FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$	381.167.322,31
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJ/AM	R\$	-
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJ/AM COBERTURA	R\$	1.517.097,64
TJ/AM - FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$	32.046.672,56
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA - FPREV	R\$	-
TOTAL	R\$	414.731.092,51

TRIBUNAL DE CONTAS DO ESTADO - TCE/AM		SALDO
TCE/AM FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$	133.717.150,40
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TCE	R\$	-
TCE/AM - FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$	5.650.926,46
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TCE/FPREV	R\$	-
TOTAL	R\$	139.368.076,86

OUTROS RECURSOS		SALDO
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO EXECUTIVO	R\$	43.102.263,44
DISP. FINANCEIRA - TAXA DE ADM. EXECUTIVO	R\$	1,00
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - ALE	R\$	1.015.723,93
DISP. FINANCEIRA - TX DE ADM. ALE	R\$	-
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO TCE	R\$	578.078,54
DISP. FINAN CEIRA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO TCE	R\$	-
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO TJA	R\$	1.549.464,50
DISP. FINANCEIRA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO TJA	R\$	-
FUNDO FINANCEIRO - EXECUTIVO	R\$	1.728.850,03
FUNDO FINANCEIRO - COMPREV	R\$	4.435.497,03
DISP. FINANCEIRA - FFIN EXECTIVO	R\$	1,00
DISP. FINANCEIRA - FFIN EXECUTIVO - COBERT. DEFICIT	R\$	34.865,65
DISP. FINANCEIRA - SAL. NÃO RECLAMADOS	R\$	124.313,89
DISP. REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$	0,02
DISP. FINANCEIRA - FUNDO TEMPORÁRIO	R\$	11.124.407,46
TOTAL	R\$	63.693.466,49
TOTAL GERAL	R\$	5.550.725.440,98

Quadro 46.

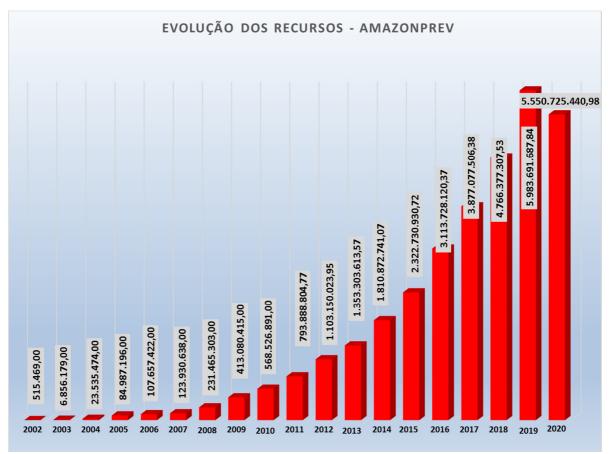


Gráfico 5.

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, foi utilizado o valor de R\$ 86.967.230,58 (oitenta e seis milhões de reais, novecentos e sessenta e sete mil, duzentos e trinta reais e cinquenta e oito centavos) resgatado do fundo Bradesco DI Premium no mês de abril/2020 do FPREV Executivo. 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.

15. PLANO DE AÇÃO MENSAL

	PLANO DE AÇÃO MENSAL	RESPONSÁVEL	PRAZO
	a) Ratear os novos recursos entre os fundos: AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC FIA (CNPJ/MF 34.791.108/0001-61); BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA (11.977.794/0001-64); OCCAM FICFIA (11.628.883/0001-03);	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/07/2020
FPREV EXECUTIVO:	b) Migrar o valor de até R\$ 20 milhões para fundos de Investimentos no exterior BDR, conforme segue: 1. fundo BB Previdenciário Alocação Ativa para o fundo BB FI AÇÕES BDR NÍVEL I; 2. fundo SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF para o fundo SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR (19.436.818/0001-80);	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/07/2020
FPREV ALE:	Recursos Atuais: direcionar os novos recursos para os fundos OCCAM FICFIA (11.628.883/0001-03) e SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR (19.436.818/0001-80)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/07/2020
FPREV MPE/PGJ:	Novos Recursos: Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Alocação Dinâmica, visando obter resultados acima do CDI no Longo prazo	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/07/2020
FPREV - DPE/AM	Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Alocação Dinâmica, visando obter resultados acima do CDI no Longo prazo.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/07/2020
FPREV - TJ/AM	Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Institucional FIC FI RF IMA-B 5	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/07/2020
FPREV - TCE/AM	Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Institucional FIC FI RF IMA-B 5	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/07/2020
Outros Repasses – TCE e TJAM	a) Novos recursos: os novos recursos recebidos pelo TCE e TJAM, devem ser direcionados para o fundo Maxi Poder Público	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/07/2020
FFIN - EXECUTIVO, ALE, DPE e MPE	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	15/07/2020
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	15/07/2020
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	15/07/2020

Quadro 47.

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

16. RELATÓRIO DE RISCO DOS ATIVOS

16.1 ACOMPANHAMENTO DOS RISCOS POR FUNDO DE INVESTIMENTOS

RELATÓRIO DE RISCOS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO E CARTEIRA DA AMAZONPREV

abr/20

	VOL. ANU	ALIZADA	VAR (95%)	SHARPE	DRAW	abr/20
FUNDOS DE INVESTIMENTOS	MÊS %	12 M %	MÊS %	12 M %	12 M %	MÊS %	12 M %
BB PREVID IMA B 5+ TIT PUB RF	51,96%	16,78%	84,99%	######	0,13418	-18,57%	-18,57%
BB PREVID RF IRFM 1 TP	1,28%	0,45%	2,13%	0,77%	2,22584	-0,26%	-0,26%
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC DE FI	16,53%	5,33%	27,10%	8,80%	0,55268	-5,49%	-5,49%
BB PREVID TIT PUB VII FI	6,40%	2,22%	10,46%	3,67%	0,63136	-2,66%	-2,66%
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	46,65%	38,82%	77,19%	63,83%	-0,47538	-41,39%	-44,79%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	18,51%	5,83%	30,36%	9,62%	0,38655	-5,88%	-5,88%
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	46,97%	41,14%	77,98%	67,70%	-0,18581	-43,86%	-46,11%
BRADESCO FI REFER DI PREMIUM	0,37%	0,15%	0,61%	-0,18%	-2,91486	-0,18%	-0,18%
BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL	117,57%	39,34%	192,03%	64,64%	-0,65122	-46,69%	-46,69%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	15,05%	4,87%	24,68%	8,04%	0,73165	-5,66%	-5,66%
BRADESCO MAXI PD PÚBLICO	0,02%	0,06%	0,04%	0,11%	-4,22038	0,00%	0,00%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	52,28%	43,22%	86,81%	71,11%	-0,16955	-43,22%	-45,47%
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	2,64%	3,90%	4,28%	6,41%	-1,44227	-3,76%	-3,76%
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	24,14%	8,49%	39,59%	13,99%	0,10539	-10,12%	-10,12%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF	14,00%	4,56%	22,94%	7,54%	0,75177	-5,40%	-5,40%
CAIXA FI BRASIL IRFM 1	1,27%	0,45%	2,11%	0,76%	2,40206	-0,25%	-0,25%
CAIXA FIA CONSUMO	121,61%	40,85%	198,65%	67,20%	-0,28801	-47,02%	-47,02%
CAIXA GESTÃO ESTRATEGICA	15,74%	5,30%	25,89%	8,77%	1,44475	-4,27%	-4,27%
ICATU DIVIDENDOS FIA	101,61%	33,94%	165,77%	55,78%	-0,57770	-44,83%	-44,83%
ICATU INFLAÇÃO CRÉDITO PRIVADO	16,71%	5,37%	27,29%	8,85%	0,01709	-6,53%	-6,53%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA	14,65%	4,75%	24,02%	7,85%	0,72478	-5,56%	-5,56%
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA	52,50%	16,96%	85,89%	27,93%	0,11344	-18,81%	-18,81%
ICATU VANGUARDA AÇÕES IBrX FI	121,12%	40,38%	197,88%	66,34%	-0,69286	-47,90%	-47,90%
ITAU AÇÕES PHOENIX FIC FI	55,38%	47,65%	91,59%	78,31%	-0,60638	-54,06%	-55,79%
ITAU DUNAMIS FIC	113,27%	38,13%	184,80%	62,67%	-0,60058	-47,39%	-47,39%
ITAU FOF RPI AÇÕES	118,93%	39,49%	194,21%	64,90%	-0,63938	-46,95%	-46,95%
ITAU SMALL CAPS VALUATION	48,33%	42,79%	80,05%	70,41%	-0,17700	-47,99%	-51,24%
ITAU INSTIT ALOC DINÂMICA RF FIC	0,75%	1,32%	1,25%	2,21%	3,19973	-0,11%	-0,42%
SAFRA IMA INST. FI FIC RF	21,36%	13,86%	35,23%	22,85%	0,36625	-9,97%	-13,28%
SAFRA S&P REAIS PB MM	82,59%	28,35%	135,27%	46,60%	-0,49075	-34,78%	-34,78%
SANTANDER AÇÕES TOP SELEÇÃO	112,95%	38,40%	184,21%	63,08%	-0,79062	-48,30%	-48,30%
SANTANDER ATIVO RENDA FIXA	1,82%	2,13%	3,02%	3,54%	2,49295	-0,44%	-1,64%
SANTANDER SELEÇÃO 30	47,70%	40,47%	79,03%	66,53%	-0,57368	-45,96%	-48,30%
SANTANDER IBOVESPA AÇÕES	120,31%	40,36%	196,38%	66,30%	-0,76212	-49,37%	-49,37%

RISCOS DA CARTEIRA AMAZONPREV

							abr/20
CARTEIRA AMAZONPREV	9,24%	3,82%	15,08%	6,32%	1,26848	-3,38%	-3,38%

Quadro 48.

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

Nota 2: VALUE at RISK (95%): Sintetiza a maior perda esperada para a Carteira no intervalo de um dia. Seu cálculo baseia-se na média e no desvio padrão dos retornos diários da Carteira, e supõe que estes seguem uma distribuição

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

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

16.2 DETALHAMENTO POR FUNDO DE INVESTIMENTOS

											2
FUNDOS DE INVESTIMENTOS	CNPJ	GESTOR	ENQUADRAMENTO	BENCHMARK	SALDO	PRAZO DE DURAÇÃO DO ATIVO	PRAZO DE RESGATE	rióndez	VOLATILIDADE ATRIBUÍDA PELO ADMINISTRA ADOR	CONCEITO DA VOLATILIDADE PEPPESENTADA (PISCO)	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO
ab Previor Firem 1 TP	11.328.882/0001-35	BBDTVM	ART. 7°, 1, "b"	IRF-M1	134.691.211,38	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	1	MUITOBAIXO	2,500%
BRADESCO FI REFER DI PREMIUM	03.399.411/0001-90	BRAM - DTVM	ART. 7°, IV, "a"	CDI	98.353.171,41	INDETERMINADO	0+0	CURTO PRAZO	1	MUITOBAIXO	0,200%
6 BRADESCO FIRF MAXI PODER PUB	08.246.263/0001-97	BRAM - DTVM	ART. 7°, IV, "a"	CDI	27.841.831,77	INDETERMINADO	0+0	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,200%
NTN-B	•	TESOURO NACIONAL	ART. 7°, I, "a"	IPCA + 6,48% a.a	156.066.395,60	15/05/2023	D+1	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	%000'0
NTN-B	•	TESOURO NACIONAL	ART. 7°, 1, "a"	IPCA + 6,59% a.a	160.220.985,52	15/08/2030	D+1	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	%000'0
NTN-B	•	TESOURO NACIONAL	ART. 7°, I, "a"	IPCA + 6,90% a.a	161.540.365,29	15/08/2030	D+1	CURTO PRAZO	1	MUITOBAIXO	%000'0
NTN-B	•	TESOURO NACIONAL	ART. 7°, 1, "a"	IPCA + 6,60% a.a	163.814.827,81	15/08/2040	D+1	CURTO PRAZO	1	MUITOBAIXO	%000'0
CVS-A	•	TESOURO NACIONAL	Em enquadramento	0,50% a.m	1.397.079,34	01/01/2027	٠	LONGO PRAZO	1	MUITOBAIXO	%000'0
CVS-B	•	TESOURO NACIONAL	Em enquadramento	3,12% a.a	9.039.824,90	01/01/2027	•	LONGO PRAZO	1	MUITOBAIXO	%000'0
CVS-C	•	TESOURO NACIONAL	Em enquadramento	0,50% a.m	181.231,96	01/01/2027	1	LONGO PRAZO	1	MUITOBAIXO	%00000
CVS-D	•	TESOURO NACIONAL	Em enquadramento	3,12% a.a	991.337,16	01/01/2027	1	LONGO PRAZO	1	MUITOBAIXO	%0000'0
					914.138.262,14						%000'0
88 PREVID TIT PUB VII FI	19.523.305/0001-06	B8 DTVM	ART. 7°, 1, "b"	IMA-B	19.195.307,82	15/08/2022	D+1	MÉDIO PRAZO	2	BAIXO	0,200%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA	10.922.432/0001-03	ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7°, 1, "b"	IMA-B5	53.998.663,06	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	2	BAIXO	0,400%
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.740.670/0001-06	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	ART. 7°, 1, "b"	IRF-M1	263.935.285,25	INDETERMINADO	0+0	CURTO PRAZO	2	BAIXO	0,200%
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	28.515.874/0001-09	BRAM - DTVM	ART. 7°, IV, "a"	IPCA	126.742.178,52	INDETERMINADO	D+4	CURTO PRAZO	2	BAIXO	0,400%
SAFRA S&P REAIS PB MM	21.595.829/0001-54	SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA	ART. 8°, III	CDI	17.062.822,72	INDETERMINADO	D+2	CURTO PRAZO	2	BAIXO	0,200%
					480.934.251,31					,	
BRADESCO FIC RF IMA B5	20.216.216/0001-04	BRAM - DTVM	ART. 7°, IV, "a"	IMA-B5	120.077.350,29	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	8	MÉDIO	
CAIXA BR GESTÃO ESTRATÉGICA	23.215.097/0001-55	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7°, IV, "a"	IPCA	522.896.974,11	INDETERMINADO	D+0	CURTO PRAZO	8	MÉDIO	1,600%
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	22.791.028/0001-27	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7°, 1, "b"	IMA-B	43.271.050,93	16/08/2020	•	MÉDIO PRAZO	3	MÉDIO	1,600%
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	22.791.074/0001-26	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7°, 1, "b"	IMA-B	51.209.039,94	16/08/2024	•	LONGO PRAZO	3	MÉDIO	2,000%
SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI	26.507.132/0001-06	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7°, IV, "a"	IPCA	93.254.608,05	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	3	MÉDIO	0,400%
CAIXA FI BRASIL IMA 85 TP RF	11.060.913/0001-10	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7°, 1, "b"	IMA-B5	617.091.668,27	INDETERMINADO	D+0	CURTO PRAZO	3	MÉDIO	0,400%
					1.447.800.691,59						
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	11.977.794/0001-64	BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	ART. 8°, II, "a"	IBOVESPA	164.284.868,53	INDETERMINADO	D+33	CURTO PRAZO	4	ALTO	3,000%
CAIXA FIA CONSUMO	10.577.512/0001-79	CAIXA ECONÔMICA	ART. 8°, II, "a"	ICON	72.096.953,72	INDETERMINADO	D+3	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,10% a 0,30%
ICATU DIVIDENDOS FIA	08.279.304/0001-41	ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8°, II, "a"	IBOVESPA	189.834.077,11	INDETERMINADO	D+4	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,200%
ICATU INFLAÇÃO CRÉDITO PRIVADO	19.719.727/0001-51	ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7°, VII, "a"	IMA-85	25.789.954,81	INDETERMINADO	D+21	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,200%
BRADESCO FIC AÇÕES INSTITUCIONAL IBIX ALPHA	14.099.976/0001-78	BRAM - DTVM	ART. 8°, 1, "a"	IBOVESPA	23.540.406,36	INDETERMINADO	D+2	CURTO PRAZO	4	ALTO	%006'0
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA	30.659.168/0001-74	BANCO J. SAFRA S/A	ART. 7°, I, "b"	IMA-B	115.400.334,64	INDETERMINADO	D+4	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,200%
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA	10.756.541/0001-06	ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7°, 1, "b"	IMA-85+	101.213.326,64	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,200%
ICATU VANG. IBX FI AÇÕES	06.224.719/0001-92	ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8°, 1, "a"	IBOVESPA	18.531.869,22	INDETERMINADO	D+4	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,35% A 0,40%
BB AÇÕES VALOR	29.258.294/0001-38	B8 DTVM	ART. 8°, 1, "a"	IBOVESPA	70.321.147,48	INDETERMINADO	D+32	CURTO PRAZO	4	ALTO	2,000%
BRADESCO FI EM AÇÕES MID SMALL CAPS	06.988.623/0001-09	BRAM - DTVM	ART. 8°, 1, "a"	IBOVESPA	95.825.263,28	INDETERMINADO	D+3	CURTO PRAZO	4	ALTO	1,500%
ITAU INSTIT ALOC DINÂMICA I	21.838.150/0001-49	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 7°, IV, "a"	IPCA	241.790.064,85	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,200%
					1.118.628.266,64						
88 PREVID TIT PUB IMA B5 +	13.327.340/0001-73	B8 DTVM	ART. 7°, 1, "b"	IMA-8 5+	162.978.919,70	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	2,500%
88 PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC DE FI	25.078.994/0001-90	B8 DTVM	ART. 7°, 1, "b"	IMA-B	930.354.877,17	INDETERMINADO	D+3	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	0,300%
SANTANDER IBOVESPA INSTITUCIONAL AÇÕES	01.699.688/0001-02	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8°, II, "a"	IBOVESPA	74.094.302,36	INDETERMINADO	D+3	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	0,750%
ITAU AÇÕES PHOENIX FIC FI	23.731.629/0001-07	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 8°, II, "a"	IBOVESPA	94.688.731,95	INDETERMINADO	D+24	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	1,900%
SANTANDER SELEÇÃO 30 AÇÕES FIC FI	29.549.642/0001-26	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8°, II, "a"	IBOVESPA	34.621.926,62	INDETERMINADO	D+29	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	2,00% a 2,50%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FI AÇÕES	01.063.897/0001-65	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 8°, II, "a"	IBOVESPA	37.928.799,42	INDETERMINADO	D+3	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	2,000%
ITAU DUNAMIS FIC FIA	24.571.992/0001-75	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 8°, II, "a"	IBOVESPA	122.301.770,19	INDETERMINADO	D+24	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	1,500%
ITAU FOF RPI AÇÕES	08.817.414/0001-10	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 8°, II, "a"	IBOVESPA	7.426.780,89	INDETERMINADO	D+5	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	0,400%
SANTANDER AÇÕES TOP SELEÇÃO	02.436.763/0001-05	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8°, II, "a"	IBOVESPA	51.445.200,86	INDETERMINADO	D+4	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	%005'0
					1.515.841.309,16						

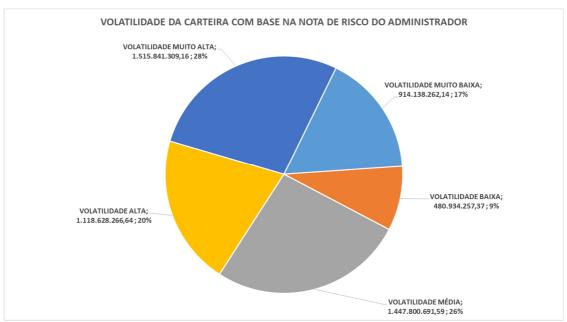


Gráfico 6.

17. VERIFICAÇÃO DE LASTRO DOS FUNDOS DE RISCO DE CRÉDITO

RATION & YIELD POR CL	ASSE
Duration	Spread
3,23	2,75%
0,00	0,00%
2,18	1,36%
0,78	1,54%
0,00	0,00%
2,08	0,73%
0,00	0,00%
4,70	-
0,00	-
2,97	2,47%
0,84	1,87%
2,39	1,87%
	0,00 2,18 0,78 0,00 2,08 0,00 4,70 0,00 2,97 0,84

TABELA - RATING EXTERNO*				
Rating	Financeiro	% PL		
AAA	129.144.390	23,3%		
AA+	53.855.777	9,7%		
AA	146.398.976	26,4%		
AA-	5.339.994	1,0%		
A+	46.769.409	8,4%		
DPGE	0	0,0%		
A	15.500.301	2,8%		
A-	0	0,0%		
BBB+	14.816.979	2,7%		
BBB	0	0,0%		
BBB-	2.497.465	0,5%		
BB+	0	0,0%		
BB	0	0,0%		
BB-	5.405.141	1,0%		
B+	0	0,0%		
В	0	0,0%		
B-	0	0,0%		
ccc	0	0,0%		
cc	0	0,0%		
С	0	0,0%		
Sem Limite	0	0,0%		
Tesouro / Over	134.092.889	24,2%		
Total	553.821.320	100,0%		

	TABELA - SETOR	
Setor	Financeiro	% PL
Elétrico	110.605.120	20,0%
Bancos	77.651.827	14,0%
Saneamento	57.444.651	10,4%
Conc. Rodoviárias	45.801.627	8,3%
Serviço	32.610.180	5,9%
Varejo	19.457.236	3,5%
Shopping Center	17.532.329	3,2%
Óleo e Gás	17.086.267	3,1%
Holding	12.620.574	2,3%
Mineração e Siderurgia	11.781.851	2,1%
Consumo	7.888.302	1,4%
Papel e Celulose	3.921.052	0,7%
Logistica	2.872.850	0,5%
Infraestrutura	2.454.566	0,4%
Tesouro / Over	134.092.889	24,2%
Total	553.821.320	100,0%

Quadro 50.

T	ABELA - EMISSOR	
Emissor	Financeiro	% PL
Copasa	20.455.140	3,7%
Lojas Americanas	17.597.962	3,2%
Cemig Distribuição	14.816.979	2,7%
CCR Autoban	13.212.972	2,4%
Litel Participações	12.620.574	2,3%
Águas de Guariroba	12.319.699	2,2%
Copel	11.777.415	2,1%
FIDIS	10.942.633	2,0%
Usiminas	10.045.005	1,8%
Taesa	9.642.196	1,7%
Petrobras	9.547.269	1,7%
Sabesp	9.170.906	1,7%
Rota das Bandeiras	8.990.077	1,6%
Smartfit	8.920.689	1,6%
Saneago	8.380.062	1,5%
Natura	7.888.302	1,4%
Multiplan	7.751.945	1,4%
Comgás	7.538.997	1,4%
Daycoval	7.381.696	1,3%
BNB	7.349.143	1,3%
Bradesco	7.303.411	1,3%
AES Tietê Energia	7.249.077	1,3%
Light SESA	7.128.440	1,3%
Sanepar	7.118.845	1,3%
Eneva	7.030.399	1,3%
Sofisa	7.003.349	1,3%
Dasa	6.899.255	1,2%
Rio Paranapanema Energia	6.569.304	1,2%
GMAC	6.039.849	1,1%
Régis Bittencourt	5.887.280	1,1%
CCP	5.850.641	1,1%
Unidas	5.799.566	1,0%
Alfa	5.730.311	1,0%
Equatorial Energia	5.702.843	1,0%
Eletrobras	5.660.893	1,0%
Tribanco	5.426.887	1,0%
CART	5.405.141	1,0%
Safra	5.340.110	1,0%
Localiza	5.320.203	1,0%
Ecovias	5.309.042	1,0%
Omega Geração	5.283.720	1,0%
Movida	4.668.142	0,8%
Termopernambuco	4.458.481	0,8%
Itau	4.287.207 3.921.052	0,8%
Suzano		0,7%
Alupar	3.515.207	0,6%
Celpa	3.501.428	0,6%
Volkswagen ABC Brasil	3.392.822	0,6%
	2.963.348	0,5%
Eletropaulo MRS Logistica	2.918.135 2.872.850	0,5%
MRS Logistica Ecorodovias	2.872.850	0,5% 0,5%
BRMalls	2.633.225	0,5%
Enel RJ	2.556.063	0,5%
Santo Antônio Energia	2.556.063	0,5%
Gerdau	2.454.566	0,5%
Enel Ceará	2.284.994	0,4%
BANRISUL	2.137.474	0,4%
UHE Miranda	2.001.364	0,4%
São Manoel Energia	1.980.334	0,4%
Companhia Brasileira de Distribu		0,3%
Vale	1.736.846	0,3%
Ecopistas	1.693.352	0,3%
CAIXA	1.665.146	0,3%
Entrevias	1.568.019	0,3%
EDP Bandeirante	1.488.769	0,3%
EDP Escelsa	1.322.975	0,2%
Vamos Locação	1.002.326	0,2%
Iguatemi	968.519	0,2%
CCR	943.465	0,2%
Coelba	777.337	0,2%
Votorantim	688.442	0,1%
TOTO GITTIN	441.302	0,1%
Delta3		
Delta3 Aliansce Sonae		
Delta3 Aliansce Sonae Tesouro / Over	328.000 134.092.889	0,1% 24,2%

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 15 de junho de 2020, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de maio/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, 15 de junho 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: