



# *RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS*

*Agosto / 2020*

*RELATÓRIOS - 2020*

# Relatório de Investimentos – Agosto/2020

Destino: DIRAF / PRESI

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

Data: 15/09/2020

## RELATÓRIO Nº. 031/2020 – COMIV

Senhores Diretores,

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

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 03 a 06);
- 2) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Poder Executivo, apresentando os saldos e **performance** dos Fundos de Investimentos, evolução dos saldos dos Fundos de Investimentos, imóveis e CVS, comparativo da rentabilidade com a Meta Atuarial, Evolução e variação dos recursos do FPREV Executivo (páginas 07 a 13)
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 13 a 15)
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (página 16)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (página 17)
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (página 18)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (páginas 19)
- 8) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado – FPREV (página 20)
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro: Executivo, DPE, ALE e MPE – (páginas 21)
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 22)
- 11) Outros Recursos do Tribunal de Justiça – TJ/AM e Tribunal de Contas do Estado - TCE: Saldos (página 23)
- 12) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 24 a 28)
- 13) Total dos Recursos e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 30)
- 14) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 31)
- 15) Relatório de Riscos da Carteira (página 32 a 37)
- 16) Parecer do Comitê de Investimentos (página 38).





### 1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

Com apoio dos Relatórios: Carta do Gestor – Setembro/2020, emitido pela BRAM Asset Management:

O Comitê de Política Monetária (Copom) reduziu a taxa Selic em 0,25 p.p, com a indicação que a taxa de juros deve ser mantida próxima do patamar atual por período prolongado.

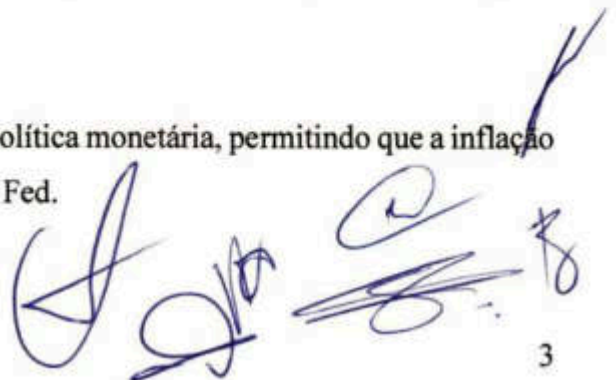
Em decisão unânime, a Selic passou de 2,25% para 2,00% a.a., corte em linha com a expectativa de mercado. No comunicado, o Comitê ressalta que a pandemia causada pelo Covid-19 continua provocando a maior retração global desde a Grande Depressão. O Copom também destacou que a economia brasileira demonstra sinais de recuperação parcial, porém não de forma homogênea entre os setores.

A respeito do balanço de riscos para a inflação, o BC ressalta que permanecem riscos em ambas as direções. De um lado, a pandemia acarreta aumento de incerteza e maior poupança precaucional, e com isso, potencial redução da demanda ainda maior e mais prolongada do que a estimada. Por outro lado, medidas fiscais em resposta à pandemia que gerem deterioração da trajetória fiscal de forma prolongada, aliadas à incerteza sobre a continuidade das reformas, podem elevar os prêmios de risco. Além disso, as políticas de recomposição da renda e estímulo creditício podem fazer com que a queda da demanda agregada seja menor que a esperada.

Para o Banco Central, esse cenário continua a prescrever estímulo monetário extraordinariamente elevado, mas reconhece que o espaço remanescente de política monetária, se houver, deve ser pequeno. Com isso em consideração o Copom introduziu a “forward guidance” de que a Selic deve permanecer onde está até a expectativa de inflação estar próxima da meta no horizonte relevante da política monetária (2021 e, em menor grau, 2022).

Em termos de dados econômicos, a inflação segue em patamar baixo e a atividade em trajetória de recuperação. A prévia da inflação ao consumidor (IPCA-15) de agosto avançou 0,23%, acumulando alta de 2,3% em 12 meses. A média dos núcleos de inflação (exclui itens voláteis) registrou alta de 0,14% no mês e de 2,0% em 12 meses. Em linhas gerais, o cenário de preços segue benigno. Nossa projeção para 2020 segue em 1,7%, abaixo do piso da meta do Banco Central (2,5%). O Índice de atividade econômica do Banco Central (IBC-Br) avançou 4,9% em junho. O indicador prévio do PIB apresentou crescimento, refletindo as altas da indústria (8,9%), do comércio (12,6%) e do setor de serviços (5,0%) no mês. Na comparação interanual, o índice recuou 7,1%. Os números são compatíveis com as expectativas de queda de 5,2% do PIB nesse ano.

Nos Estado Unidos, Powell anuncia a revisão do arcabouço de política monetária, permitindo que a inflação supere 2% por algum tempo, sem a necessidade de reação pelo Fed.



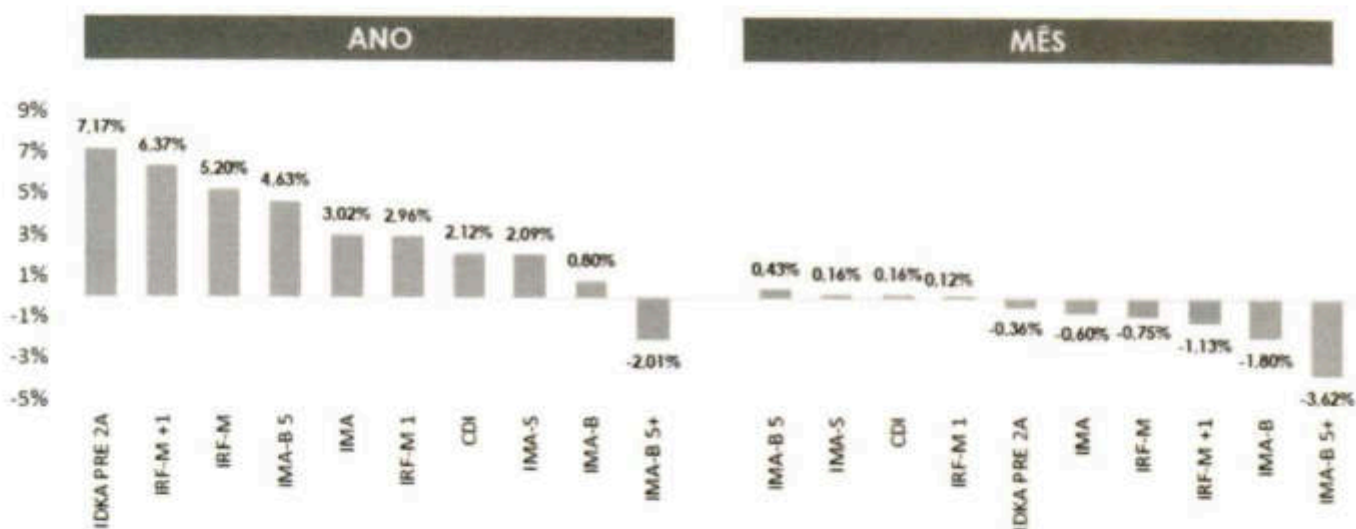


## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

Durante o simpósio anual de Jackson Hole, o presidente do Fed, Jerome Powell, anunciou alterações na condução da política monetária, em especial no que diz ao alcance das metas de inflação e emprego. No caso da inflação, o Fed adotará a média da variação dos preços como métrica de alcance da meta de 2%. Na prática, o Fed permitirá que a inflação supere 2% em alguns períodos, de modo a compensar os períodos abaixo da meta, como o atual. No que concerne ao emprego, o Fed perseguirá a maximização da criação de empregos, ao invés de se guiar exclusivamente pelo desvio da taxa de desemprego em relação à taxa de equilíbrio. Com essas mudanças, o Fed pretende potencializar a política monetária expansionista, sinalizando que a taxa de juros permanecerá próxima de zero por um período prolongado.

Índices de confiança da Zona do Euro e EUA avançam em julho e já superam patamar pré-crise. O PMI composto (serviços e indústria) da Zona do Euro atingiu 54,9 pontos em julho ante 48,5 em junho (abaixo de 50 pontos indica contração). Enquanto isso, o PMI composto dos EUA aumentou para 50,3 pontos em julho, ante 47,9 em junho. O índice dos EUA foi o melhor desde janeiro e o indicador da Zona do Euro chegou ao seu maior valor desde julho de 2018. A continuidade na melhora da confiança segue dependendo da evolução da pandemia e da reabertura nos países, e especialmente da recuperação do mercado de trabalho. Os índices são compatíveis com uma recuperação da atividade no 2º semestre, porém ainda condizente com queda de 3% do PIB Global em 2020.

### RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA FIXA



O mês de agosto foi marcado pelo aumento da volatilidade nos mercados locais. Entretanto, no cenário externo, a ininterrupta reabertura das economias, somada a um avanço na conclusão dos testes das vacinas, tem trazido maior confiança no que diz respeito a recuperação mais rápida da atividade. Conforme comentado anteriormente, o risco de uma nova onda de contaminação persiste e algumas localidades pelo mundo estão acompanhando o aumento nos números de casos com atenção. Nos Estados Unidos, as

4



## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

eleições começam a ter maior relevância nos noticiários, o que pode levar uma maior volatilidade para os mercados, conforme a disputa for se acirrando.

O aumento do risco local ocorreu principalmente devido às incertezas sobre o comprometimento do governo no tocante a agenda fiscal. Adicionalmente, os desentendimentos entre governo e ministros também têm contribuído para o aumento da tensão. Por outro lado, os dados de atividade e confiança, assim como no resto do mundo, mantiveram a tendência de recuperação, suportados pelos estímulos financeiros disponibilizados pelo governo, que serão mantidos até o final do ano. Por fim, no cenário da BRAM se espera uma queda de 5,2% do PIB em 2020 uma manutenção da inflação em 1,7% além da permanência da taxa Selic no patamar atual de 2% até meados de 2021 devido a uma preocupação com a inflação de 2022.

Neste mês, observou-se uma alta nos vértices intermediários e longos dos ativos de renda fixa. Os vértices mais curtos tiveram movimentos distintos, os prefixados abriram levemente, já os ativos atrelados à inflação caíram devido à uma recomposição na inflação, que pode ser percebida nas taxas implícitas de curto prazo. Todo o movimento observado na curva de juros, transparece o receio dos investidores com relação a situação fiscal. Por fim, o dólar também refletiu este receio, fechando a R\$ 5,4713 com alta de 5,15% no mês.

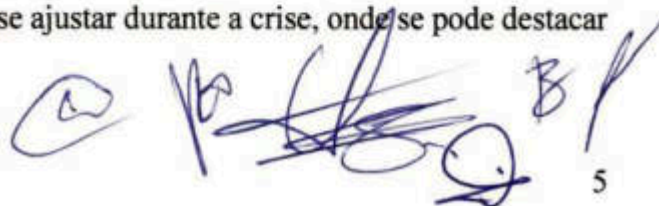
### RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA VARIÁVEL

	AGOSTO	2020	12 MESES	24 MESES	36 MESES
IBOVESPA	-3,44%	-14,07%	-1,75%	29,59%	40,28%
SMLL	-1,23%	-14,27%	6,02%	60,17%	56,43%
IBRX	-3,38%	-13,46%	-1,12%	33,35%	43,15%
IDIV	-4,83%	-17,25%	-3,64%	44,78%	45,20%
S&P 500 (USD)	7,01%	8,34%	19,61%	20,64%	41,62%
MSCI World (USD)	6,53%	4,11%	14,82%	12,87%	25,30%

Após quatro meses seguidos de recuperação expressiva, a bolsa brasileira apresentou resultado negativo em agosto, destoando do comportamento das bolsas globais.

No mundo, permanece o clima positivo impulsionado por dados de atividade em contínua recuperação, resultados das empresas no 2º trimestre acima do esperado e expectativa positiva em torno da vacina para o Covid 19.

Tem ficado mais evidente que as bolsas de maior destaque de valorização têm maior participação de setores que foram menos impactados nesta pandemia ou que estão se beneficiando desta nova realidade, seja pelo uso intensivo de tecnologia, seja pela maior capacidade de se ajustar durante a crise, onde se pode destacar



5

## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

---

os setores de Tecnologia, Telecomunicações, Varejo E-commerce e empresas do setor de Saúde. Com isso, o S&P 500 teve retorno de 9,6% alcançando ganho no ano de 9,3% (chegou a ser de -34% no ano). O índice Nasdaq teve retorno de 6,8% acumulando o impressionante retorno de 31,2% no ano.

No Brasil, o Ibovespa teve retorno de -3,4%, ampliando a queda no ano pra -14,1%. Apesar do clima positivo no mundo, a maior atenção do mercado para o risco de deterioração fiscal ajuda a explicar a desvalorização do Real (cerca de 4,9% e o descolamento do comportamento do Ibovespa). Apesar da piora recente, o mercado financeiro ainda continua com visão positiva para renda variável no médio e longo prazos, onde se pode destacar fatores como a expectativa de retomada da agenda de reformas do governo, continuidade de revisões menos negativas para o PIB, juros em patamares historicamente baixos e o fluxo do investidor local para a bolsa.

O grande destaque de agosto foi a performance do setor de Papel Celulose, que se beneficiou da forte alta do dólar e da recuperação dos preços da celulose. O setor de Saúde também foi destaque devido a ótima performance das operadoras durante a pandemia, proporcionando não só lucros expressivos, mas também novas parcerias e aquisições. Outro setor de destaque foi o de Alimentos & Agronegócio, principalmente pelo desempenho da Marfrig que apresentou melhora expressiva no desempenho operacional e teve incremento de receita com maior demanda da China. Por outro lado, os setores mais impactados pela pandemia continuaram se destacando negativamente, como o de Educação, Shoppings & Properties e Bancos.





## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

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

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2020	31/08/2020	jun/20	jul/20	ago/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 675.771.367,31	R\$ 619.887.968,84	0,9486	1,7677	(0,8887)	1,8201%	2,6284%	NC
BB PREVID TP VII	R\$ 19.690.546,75	R\$ 6.846.386,96	0,9923	0,3200	0,4697	1,7914%	2,4459%	6,0548%
BB PREVID RF IMA B5+	R\$ 181.529.262,91	R\$ 174.834.128,07	2,8000	7,2780	(3,6881)	6,2145%	-2,2322%	NC
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 63.164.341,90	R\$ 51.431.559,20	0,9500	1,7100	(0,8600)	1,7932%	2,6228%	NC
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 4.164.314,05	R\$ 2.000.876,94	0,1928	0,1702	0,1400	0,5039%	1,9135%	3,5592%
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF	R\$ 44.035.009,99	R\$ -	0,8900	0,0700	-	0,9606%	0,8035%	3,9386%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 54.420.931,13	R\$ 53.071.179,30	1,2400	1,7700	(2,4800)	0,4768%	3,0778%	8,3729%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 535.189.051,03	R\$ 439.311.958,19	1,0986	0,9736	0,3918	2,4829%	4,4532%	8,9247%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 523.590.614,37	R\$ 520.673.388,21	0,7496	0,9773	(0,5572)	1,1674%	5,0592%	9,2098%
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 26.675.527,13	R\$ 26.823.203,87	1,4600	1,9300	0,5500	3,9870%	3,7779%	7,3363%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 56.325.035,64	R\$ 56.513.555,53	1,0800	1,0200	0,3300	2,4480%	4,4489%	8,9677%
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 112.773.605,36	R\$ 108.641.047,13	2,7800	7,3500	(3,6600)	6,2961%	-2,2729%	4,4008%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 240.651.175,07	R\$ 240.351.041,05	0,4358	0,5500	(0,1200)	0,8670%	2,7037%	4,7377%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 109.613.886,14	R\$ 77.807.918,49	2,1100	4,8100	(2,0300)	4,8490%	2,1618%	8,5589%
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>R\$ 2.647.594.668,78</b>	<b>R\$ 2.378.194.211,78</b>						
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2020	31/08/2020	jun/20	jul/20	ago/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 86.382.918,14	R\$ 83.313.019,03	7,4382	6,3769	(3,5538)	10,2278%	-22,4474%	NC
BB FIA BDR NIVEL I	R\$ 15.534.771,99	R\$ 49.158.658,32	3,1871	1,1293	14,8205	19,8179%	19,8179%	NC
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 119.480.939,78	R\$ 117.595.402,80	8,5000	8,2300	(1,5800)	15,5742%	-10,0777%	NC
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPH	R\$ 30.102.602,94	R\$ 29.216.686,03	8,7400	8,4300	(2,9400)	14,4403%	-11,9203%	0,5378%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 238.803.808,82	R\$ 274.849.491,59	15,9666	8,3800	(0,4324)	25,1412%	4,0359%	15,8375%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 91.229.733,10	R\$ 89.776.442,27	9,8030	7,4124	(1,5930)	16,0632%	-6,2514%	9,3048%
ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FI	R\$ 24.040.384,89	R\$ 23.325.961,45	9,2500	8,7600	(2,9700)	15,2913%	-12,6207%	NC
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 225.689.676,46	R\$ 215.546.184,30	7,8900	4,3600	(4,4900)	7,5385%	-20,3167%	-10,0228%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 151.427.864,43	R\$ 151.130.951,01	11,8849	7,5400	(0,2000)	20,0804%	-14,4261%	-0,1591%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 9.443.993,83	R\$ 9.159.400,45	8,6184	8,4600	(3,0100)	14,2615%	-12,2790%	0,9775%
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 122.608.987,81	R\$ 117.796.634,35	12,0980	5,8000	(3,9200)	13,9506%	-27,3253%	-17,1576%
ITAÚ SMALL CAPS VALUATION	R\$ 47.975.710,37	R\$ 47.503.405,69	11,4837	8,5100	(0,9800)	19,7854%	-20,8317%	-20,9713%
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 64.928.538,64	R\$ 63.753.705,28	9,3061	8,9118	(1,8094)	16,8932%	-17,4484%	-6,1602%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 93.592.391,69	R\$ 90.872.219,73	7,7048	8,6543	(2,9064)	13,6246%	-17,2758%	-4,8855%
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$ 43.696.543,55	R\$ 42.905.197,45	9,3085	8,9106	(1,8110)	16,8926%	-19,0085%	NC
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 15.419.002,92	R\$ 37.161.387,62	-	2,7934	11,8461	14,9704%	14,9704%	NC
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 19.121.367,75	R\$ 20.432.900,24	0,9100	5,5800	6,8600	13,8495%	6,1820%	18,0018%
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 36.611.365,91	R\$ 74.320.849,30	0,9200	2,0200	16,0000	19,4320%	20,5777%	NC
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 41.344.206,31	R\$ 77.003.842,71	8,5400	13,8500	(3,1300)	19,7050%	19,7050%	NC
OCCAM FIC FIA	R\$ 40.362.999,80	R\$ 76.229.040,71	8,9700	9,9000	(2,2400)	17,0755%	17,0755%	NC
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 17.924.881,45	R\$ 17.561.225,84	7,9401	10,7087	(2,0288)	17,0747%	17,0747%	NC
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$ 1.535.722.690,58</b>	<b>R\$ 1.708.612.606,17</b>						
<b>TOTAL GERAL</b>	<b>R\$ 4.183.317.359,36</b>	<b>R\$ 4.086.806.817,95</b>						

Quadro 1.

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

**Nota 2:** Com base na Ata COMIV 165/2020, a Diretoria Deferiu as sugestões, apresentadas pelo COMIV em reunião ordinária, para ratear os novos recursos nos fundos: OCCAM FIC FIA, AZ Quest Small FIC FIA e BTG Absoluto



## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

Institucional FIQ FIA. Para os recursos já em carteira, foi aprovado migrar o valor de R\$ 20 milhões do fundo BB Previdenciário Alocação ativa para o fundo BB FI Ações BDR Nível I. Da mesma forma, foi aprovado migrar R\$ 20 milhões do fundo Safra IMA Institucional para o fundo Safra Consumo Americano BDR Nível I. Também aprovada a migração do valor de R\$ 20 milhões do fundo BB Previdenciário Alocação Ativa para o fundo Santander FI Global Equities Multimercado Investimento no Exterior;

**Nota 3:** No mês de agosto/2020 o fundo Caixa FI Brasil 2020 TP RF atingiu o período de carência, conforme Regulamento do fundo, assim, após disponibilizado em conta corrente foi direcionado conforme Ata 165/2020 COMIV;

**Nota 4:** De acordo com o Parecer nº. 1133/2020-COMIV, registra-se que para o desinvestimento das aplicações, visando cumprir os termos da LC 206/2020 – FTEMP, serão utilizados os recursos aplicados no fundo Caixa FI Brasil IMA B5;

### 2.2 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXECUTIVO

INSTITUIÇÃO	jun/20	jul/20	ago/20
BRADESCO	R\$ 223.171.008,32	R\$ 216.912.198,67	R\$ 200.244.524,97
BANCO DO BRASIL	R\$ 949.440.138,35	R\$ 978.908.867,10	R\$ 934.040.161,22
CAIXA	R\$ 1.337.943.607,54	R\$ 1.248.465.339,62	R\$ 1.102.832.967,97
ITAÚ	R\$ 548.953.722,26	R\$ 572.107.731,51	R\$ 565.941.432,55
SANTANDER	R\$ 200.874.958,80	R\$ 217.636.476,80	R\$ 234.692.510,08
ICATU/BEM DTVM	R\$ 425.345.602,67	R\$ 445.504.229,48	R\$ 430.849.952,28
SAFRA	R\$ 158.582.043,20	R\$ 165.346.619,80	R\$ 172.561.668,03
BTG PACTUAL	R\$ 210.094.782,32	R\$ 238.803.808,82	R\$ 274.849.491,59
AZ QUEST	R\$ 26.533.867,70	R\$ 41.344.206,31	R\$ 77.003.842,71
OCCAM BRASIL	R\$ 26.750.741,64	R\$ 40.362.999,80	R\$ 76.229.040,71
SULAMÉRICA	R\$ 16.191.026,57	R\$ 17.924.881,45	R\$ 17.561.225,84
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 4.123.881.499,37</b>	<b>R\$ 4.183.317.359,36</b>	<b>R\$ 4.086.806.817,95</b>

Quadro 2.

### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXEC AGOSTO - 2020

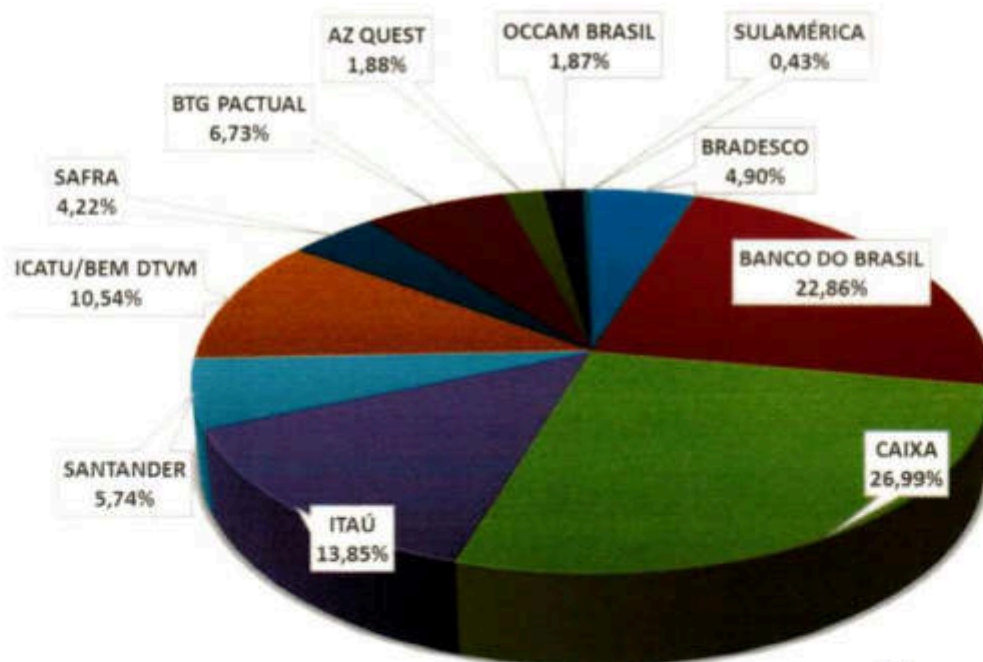


Gráfico 1



## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

### 2.3 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA – FPREV EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	ÍNDICE DE REFERÊNCIA	SALDO APLICADO	% APLICADO
BRDESCO FI MAXI PODER PUBLICO	CDI	R\$ 2.000.876,94	0,05%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA BB PREVID ALOCAÇÃO ATIVA SAFRA S&P REAIS BRDESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA ITAU INST. ALOC. DINÂMICA FI SANTANDER RF ATIVO FIC	CDI ATIVO	R\$ 1.452.776.857,54	35,55%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	IMA B	R\$ 77.807.918,49	1,90%
BRDESCO INST. FIC FI RF IMA B5 CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP ICATU VANG. FI RF INFLA. CP ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	IMA B 5	R\$ 522.648.717,59	12,79%
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF BB PREVID RF IMA B5+	IMA B5+	R\$ 283.475.175,20	6,94%
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF BB PREVID TP VII	IPCA + 6%	R\$ 59.917.566,26	1,47%
BRDESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FI	IBR X	R\$ 52.542.647,48	1,29%
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA BRDESCO FIA MID SMALL CAPS ITAU SMALL CAPS VALUATION CAIXA CONSUMO FI AÇÕES ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ITAU INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES BTG ABSOLUTO FIQ FIA SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES SANTANDER SELEÇÃO 30 AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA OCCAM FIC FIA SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	IBOVESPA	R\$ 1.474.996.163,21	36,09%
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR BB FIA BDR NIVEL I SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	BDR	R\$ 160.640.895,24	3,93%
<b>TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO</b>		<b>R\$ 4.086.806.817,95</b>	<b>100%</b>

Quadro 3.

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

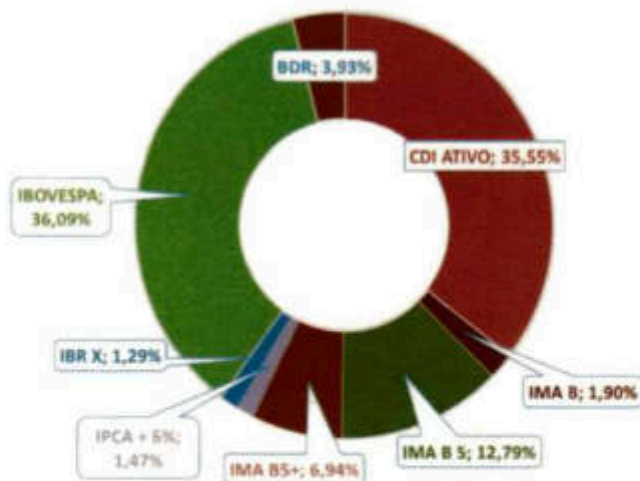


Gráfico 2.

  
 9



## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

### 2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2020	31/08/2020	jun/20	jul/20	ago/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 154.635.384,11	R\$ 155.819.667,16	0,7860	0,8865	0,7659	2,458%	5,0039%	9,0763%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 160.991.488,53	R\$ 157.987.725,61	0,7954	0,8959	0,7753	2,487%	5,0827%	9,1990%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 164.649.485,23	R\$ 161.648.091,95	0,8190	0,9196	0,7989	2,559%	5,2799%	9,5065%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 166.850.457,24	R\$ 163.804.072,94	0,7954	0,8959	0,7753	2,487%	5,0828%	9,1992%
<b>TOTAL GERAL</b>	<b>R\$ 647.126.815,12</b>	<b>R\$ 639.259.557,66</b>						

Quadro 4.

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

**Nota 2:** Registrado o pagamento semestral de cupom de juros dos títulos NTN B no valor de R\$ 12.966.761,15, justificando a redução do valor desses ativos na carteira.

### 2.6 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
TIPO DE ATIVO	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B
INTERMEDIÁRIO	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO
PREÇO UNITÁRIO DE COMPRA	R\$ 2.314,742871	R\$ 2.288,539269	R\$ 2.235,637189	R\$ 2.254,343911
QUANTIDADE	43.100	43.450	44.113	44.350
APLICAÇÃO INICIAL	R\$ 99.765.417,74	R\$ 99.437.031,23	R\$ 98.620.663,31	R\$ 99.980.152,45
<b>VALOR ATUAL</b>	<b>R\$ 155.819.667,16</b>	<b>R\$ 157.987.725,61</b>	<b>R\$ 161.648.091,95</b>	<b>R\$ 163.804.072,94</b>
DATA DE EMISSÃO	15/01/2014	10/02/2010	10/02/2010	10/02/2010
DATA DA APLICAÇÃO	15/01/2014	15/01/2014	29/01/2014	15/01/2014
DATA DO RESGATE	15/05/2023	15/08/2030	15/08/2030	15/08/2040
TAXA DE JUROS CONTRATADA	6,48%	6,5998%	6,90%	6,60%

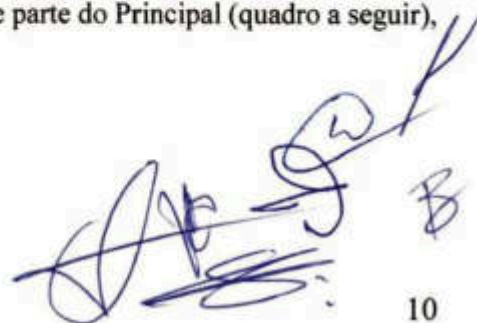
Quadro 5.

### 2.7 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	31/07/2020	31/08/2020
CVS - A	R\$ 1.362.172,70	R\$ 1.327.266,06
CVS - B	R\$ 8.813.869,30	R\$ 8.587.913,70
CVS - C	R\$ 176.703,80	R\$ 172.175,64
CVS - D	R\$ 966.558,12	R\$ 941.779,08
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 11.319.303,92</b>	<b>R\$ 11.029.134,48</b>

Quadro 6.

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





## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

### 2.8 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/20	R\$ 35.286,77	R\$ 145.084,72	R\$ 180.371,49
fev/20	R\$ 34.866,79	R\$ 145.084,72	R\$ 179.951,51
mar/20	R\$ 34.446,81	R\$ 145.084,72	R\$ 179.531,53
abr/20	R\$ 34.026,85	R\$ 145.084,72	R\$ 179.111,57
mai/20	R\$ 33.606,86	R\$ 145.084,72	R\$ 178.691,58
jun/20	R\$ 33.186,90	R\$ 145.084,72	R\$ 178.271,62
jul/20	R\$ 32.766,93	R\$ 145.084,72	R\$ 177.851,65
ago/20	R\$ 32.346,95	R\$ 145.084,72	R\$ 177.431,67
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 270.534,86</b>	<b>R\$ 1.160.677,76</b>	<b>R\$ 1.431.212,62</b>

Quadro 7.

### 2.9 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2020 (Contrato Regular)			
MÊS	UEA	SEAS	TOTAL
jan/20	R\$ -	R\$ -	R\$ -
fev/20	R\$ -	R\$ -	R\$ -
mar/20	R\$ 58.180,96	R\$ 301.093,20	R\$ 359.274,16
abr/20	R\$ 58.180,96	R\$ -	R\$ 58.180,96
mai/20	R\$ -	R\$ 301.093,20	R\$ 301.093,20
jun/20	R\$ 145.452,40	R\$ -	R\$ 145.452,40
jul/20	R\$ 43.635,72	R\$ 100.364,00	R\$ 143.999,72
ago/20	R\$ 43.635,72	R\$ 200.728,80	R\$ 244.364,52
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 349.085,76</b>	<b>R\$ 903.279,20</b>	<b>R\$ 1.252.364,96</b>

Quadro 8.

### 2.10 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	31/07/2020	31/08/2020	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.183.317.359,36	R\$ 4.086.806.817,95	85,1838%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 647.126.815,12	R\$ 639.259.557,66	13,3245%
TÍTULOS CVS	R\$ 11.319.303,92	R\$ 11.029.134,48	0,2299%
IMÓVEIS	R\$ 60.353.005,55	R\$ 60.353.005,55	1,2580%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 186.972,93	0,0039%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 4.902.116.484,95</b>	<b>R\$ 4.797.635.488,57</b>	<b>100,00%</b>

Quadro 9.



## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

### 2.11 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS – FPREV EXECUTIVO

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
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%	7,07%
mai/20	R\$ 4.808.084.982,84	1,11%	-7,07%	5,43%
jun/20	R\$ 4.837.475.067,57	0,61%	-6,50%	4,02%
jul/20	R\$ 4.902.116.484,95	1,34%	-5,25%	4,33%
ago/20	R\$ 4.797.635.488,57	-2,13%	-7,27%	-0,35%

Quadro 10.

### 2.12 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO



#### Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - EXECUTIVO2020

11/09/2020 12:35:51

#### Fundo Previdenciário

#### Cálculo Posicionado em 31/08/2020

Mês/Ano	Saldo Financeiro em 31/08/2019			Resultado R\$
	Receitas R\$	Despesas R\$	Saldo Financeiro em 31/08/2019	
09/2019	41.301.229,85	1.811.278,88	4.698.765.985,21	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	98.875.947,73		-57.002.169,92
05/2020	40.614.112,23	23.523.101,08		17.091.011,15
06/2020	32.820.094,52	149.967.929,32		-117.147.834,80
07/2020	33.058.400,54	127.901.315,43		-94.842.914,89
08/2020	39.455.936,02	98.543.877,68		-59.087.941,66
		Saldo Financeiro em 31/08/2020	4.797.635.488,57	

#### 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	2,4383%	0,6994%	0,2400%
Juros	5,8800%	3,8826%	0,4773%
Meta	8,4617%	4,6091%	0,7184%
Rentabilidade %	2,2099%	-3,2862%	-0,9260%
Rentabilidade R\$	107.399.461,65	-170.517.550,79	-45.393.636,03
Resultado %	-5,7640%	-7,5474%	-1,6327%
Resultado R\$	-303.764.221,62	-409.725.035,22	-80.611.214,68

Quadro 11.



## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

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

**Nota 2:** As Despesas foram revisados para inclusão do pagamento do FTEMP entre os meses de abril a agosto/2020. A correção foi necessária para ajustar os resultados do FPREV uma vez que esses recursos são utilizados como Despesas Previdenciárias.

ACOMPANHAMENTO DO SALDO DO FUNDO TEMPORÁRIO - FTEMP			
SALDO INICIAL FTEMP (*)		R\$ 1.088.777.939,69	
REFERÊNCIA	TOTAL DAS FOLHAS	SALDO DISPONÍVEL DO FUNDO TEMPORÁRIO (FTEMP)	
ABRIL	R\$ 86.297.366,11	R\$	1.002.480.573,58
MAIO	R\$ 541.275,12	R\$	1.001.939.298,46
JUNHO	R\$ 145.835.662,28	R\$	856.103.636,18
JULHO	R\$ 106.078.439,32	R\$	750.025.196,86
AGOSTO	R\$ 97.800.000,00	R\$	652.225.196,86
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 436.552.742,83</b>		

**Nota:** Acompanhamento do Saldo do FTEMP com base nos extratos de conta corrente (Regime de Caixa).

### 3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO						
	31/07/2020	31/08/2020	jun/20	jul/20	ago/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 5.005.029,93	R\$ 4.977.144,01	0,7496	0,9773	(0,5572)	1,1674%	5,0592%	9,2098%	
ITAU INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 4.851.703,91	R\$ 2.844.079,49	0,4400	0,5500	(0,1200)	0,8712%	2,7080%	4,7421%	
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 579.883,33	R\$ 1.587.825,91	1,4600	1,9300	0,5500	3,9870%	3,7779%	NC	
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>R\$ 10.436.617,17</b>	<b>R\$ 9.409.049,41</b>							

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO						
	31/07/2020	31/08/2020	jun/20	jul/20	ago/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES	
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 497.994,89	R\$ 475.612,80	7,8900	4,3600	(4,4900)	7,5385%	-20,3167%	-11,2420%	
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ -	R\$ 497.863,30	-	-	(0,4324)	-0,4324%	-0,4324%	NC	
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 224.291,59	R\$ 220.718,62	9,8030	7,4124	(1,5930)	16,0632%	-11,7127%	NC	
OCCAM FIC FIA	R\$ 195.223,93	R\$ 757.741,32	8,9700	9,9000	(2,2400)	17,0755%	26,7810%	NC	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 179.881,46	R\$ 287.261,90	0,9200	2,0200	16,0000	19,4320%	19,4320%	NC	
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$ 1.097.391,87</b>	<b>R\$ 2.239.197,94</b>							

<b>TOTAL GERAL</b>	<b>R\$ 11.534.009,04</b>	<b>R\$ 11.648.247,35</b>						
--------------------	--------------------------	--------------------------	--	--	--	--	--	--

Quadro 12.

#### 3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/07/2020	31/08/2020	jun/20	jul/20	ago/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES	
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.198.452,89	R\$ 2.157.467,71	0,795405	0,895939	0,775298	2,4869%	4,3055%	8,0763%	
<b>TOTAL GERAL</b>	<b>R\$ 2.198.452,89</b>	<b>R\$ 2.157.467,71</b>							

Quadro 13.

**Nota:** Registrado em agosto/2020 o recebimento de cupom de juros semestrais de NTN B, no valor de R\$ 58.029,75, justificando a redução do valor total aplicado.

## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

### 3.4 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	31/07/2020	31/08/2020
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 11.534.009,04	R\$ 11.648.247,35
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.198.452,89	R\$ 2.157.467,71
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 10,46
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 13.732.461,93</b>	<b>R\$ 13.805.725,52</b>

Quadro 14.

### 3.5 Evolução dos Recursos – ALE/FPREV

Mês	Recursos ALE FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
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%
mai/20	R\$ 13.078.781,12	1,13%	5,55%	19,91%
jun/20	R\$ 13.459.597,92	2,91%	8,62%	20,10%
jul/20	R\$ 13.732.461,93	2,03%	10,83%	20,74%
<b>ago/20</b>	<b>R\$ 13.805.725,52</b>	<b>0,53%</b>	<b>11,42%</b>	<b>17,25%</b>

Quadro 15.



## 3.6 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial



### Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - ASSEMBLEIA2020

09/09/2020 16:20:42

<b>Fundo Previdenciário</b>		<b>Cálculo Posicionado em 31/08/2020</b>		
Mês/Ano	Receitas RS	Despesas RS	Resultado RS	Saldo Financeiro em 31/08/2020
				<b>11.456.007,59</b>
				<b>Saldo Financeiro em 31/08/2019</b>
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	
05/2020	119.498,47	0,00	119.498,47	
06/2020	118.639,37	0,00	118.639,37	
07/2020	118.639,37	0,00	118.639,37	
08/2020	154.104,87	0,00	154.104,87	
				<b>Saldo Financeiro em 31/08/2020</b>
				<b>13.805.725,52</b>

<b>Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos</b>				
Taxa de Juros Anual:	5,8800 %	Índice de Inflação:	IPCA	
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês	
IPCA	2,4383 %	0,6994 %	0,2400 %	
Juros	5,8800 %	3,8826 %	0,4773 %	
Meta	8,4617 %	4,6091 %	0,7184 %	
Rentabilidade %	6,4853 %	2,4784 %	-0,5887 %	
Rentabilidade RS	788.491,49	319.742,08	-80.841,28	
Resultado %	-1,8222 %	-2,0368 %	-1,2978 %	
Resultado RS	-240.086,09	-274.800,91	-179.497,44	

Quadro 16.

# Relatório de Investimentos – Agosto/2020

## 4. RECURSOS DO MPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2020	31/08/2020	jun/20	jul/20	ago/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ -	R\$ 1.480.686,76	-	-	(0,5572)	-0,5572%	-0,5572%	NC
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 60.518.598,07	R\$ 59.998.126,68	0,9500	1,7100	(0,8600)	1,7932%	2,6228%	4,4719%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 97.802.391,03	R\$ 96.933.172,10	0,9486	1,7677	(0,8887)	1,8201%	2,5254%	5,2102%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 4.391,15	R\$ -						
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 158.325.380,25</b>	<b>R\$ 158.411.985,54</b>						

Quadro 17.

### 4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV



#### Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - PGJMP2020

00/09/2020 16:27:33

#### Fundo Previdenciário

#### Cálculo Posicionado em 31/08/2020

Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
			<b>Saldo Financeiro em 31/08/2019</b>
			<b>124.278.484,78</b>
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	2.720.674,05	16.316,13	2.704.357,92
02/2020	1.490.511,62	15.618,19	1.474.893,43
03/2020	1.275.904,25	16.735,98	1.259.168,27
04/2020	1.268.670,97	10.639,28	1.258.031,69
05/2020	1.482.380,96	0,00	1.482.380,96
06/2020	1.273.507,14	10.584,16	1.262.922,98
07/2020	1.272.066,06	11.829,88	1.260.236,18
08/2020	1.482.857,02	9.164,74	1.473.692,28
			<b>Saldo Financeiro em 31/08/2020</b>
			<b>158.411.985,54</b>

#### 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	2,4383 %	0,6994 %	0,2400 %
Juros	5,8800 %	3,8826 %	0,4773 %
Meta	8,4617 %	4,6091 %	0,7184 %
Rentabilidade %	6,5125 %	2,5476 %	-0,8761 %
Rentabilidade R\$	9.057.812,75	3.779.363,78	-1.387.086,99
Resultado %	-1,7972 %	-1,9707 %	-1,5831 %
Resultado R\$	-2.708.207,47	-3.057.405,99	-2.524.521,38

Quadro 18.



# Relatório de Investimentos – Agosto/2020

## 5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2020	31/08/2020	jun/20	jul/20	ago/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGIA	R\$ -	R\$ 951.659,78	-	-	(0,5572)	-0,5572%	-0,5572%	NC
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 8.560.449,26	R\$ 8.486.827,77	1,0900	0,9700	(0,8600)	1,1928%	3,3340%	7,8180%
BRADESCO INST. ALOC. DINAMICA	R\$ 9.578.604,04	R\$ 9.619.237,31	0,9500	1,7100	0,4200	3,1075%	3,9493%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	-	-						
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 18.139.053,30</b>	<b>R\$ 19.057.724,86</b>						

Quadro 19.

### 5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV



#### Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - DEFENSORIA2020

09/09/2020 16:22:43

#### Fundo Previdenciário

#### Cálculo Posicionado em 31/08/2020

Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
			<b>Saldo Financeiro em 31/08/2019</b>
			<b>7.265.482,57</b>
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	810.969,30	0,00	810.969,30
04/2020	818.197,74	0,00	818.197,74
05/2020	954.963,10	0,00	954.963,10
06/2020	808.818,93	0,00	808.818,93
07/2020	809.559,37	0,00	809.559,37
08/2020	951.659,78	0,00	951.659,78
			<b>Saldo Financeiro em 31/08/2020</b>
			<b>19.057.724,86</b>

#### 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	2,4383 %	0,6994 %	0,2400 %
Juros	5,8800 %	3,8826 %	0,4773 %
Meta	8,4617 %	4,6091 %	0,7184 %
Rentabilidade %	8,1656 %	4,3234 %	-0,1819 %
Rentabilidade R\$	1.001.053,58	632.232,97	-32.988,22
Resultado %	-0,2730 %	-0,2732 %	-0,8939 %
Resultado R\$	-36.088,10	-41.724,35	-163.302,03

Quadro 20.

# Relatório de Investimentos – Agosto/2020

## 6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2020	31/08/2020	jun/20	jul/20	ago/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ -	R\$ 2.867.819,59	-	-	(0,5572)	-0,5572%	(0,0056)	NC
BRABESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 42.303.722,42	R\$ 42.246.181,53	1,0900	0,9700	0,4200	2,4993%	4,6681%	9,2101%
BRABESCO ALOCAÇÃO DINAMICA RF	R\$ 1.438.723,23	R\$ 1.426.349,94	0,9500	1,7100	(0,8600)	1,7932%	2,1862%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 7.707,23	R\$ -						
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 43.750.152,88</b>	<b>R\$ 46.540.351,06</b>						

Quadro 21.

### 6.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV



#### Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - TRIBUNAL JUSTICA 2020

09/09/2020 16:31:26

#### Fundo Previdenciário

#### Cálculo Posicionado em 31/08/2020

Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
			<b>Saldo Financeiro em 31/08/2019</b>
			<b>10.397.633,05</b>
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	282.187,91	2.227.980,82
02/2020	2.546.041,07	248.112,69	2.297.928,38
03/2020	2.647.202,34	269.053,00	2.378.149,34
04/2020	3.365.431,19	341.730,86	3.023.700,33
05/2020	5.222.844,03	280.083,57	4.942.760,46
06/2020	2.652.044,89	345.842,60	2.306.202,29
07/2020	3.093.956,95	155.165,84	2.938.791,11
08/2020	3.115.630,27	491.741,78	2.623.888,49
			<b>Saldo Financeiro em 31/08/2020</b>
			<b>46.540.351,06</b>

#### 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	2,4383 %	0,6994 %	0,2400 %
Juros	5,8800 %	3,8826 %	0,4773 %
Meta	8,4617 %	4,6091 %	0,7184 %
Rentabilidade %	7,5411 %	5,2338 %	0,3801 %
Rentabilidade R\$	1.906.180,81	1.649.715,40	166.309,69
Resultado %	-0,8487 %	+0,5972 %	-0,3359 %
Resultado R\$	-230.598,76	+196.372,56	-147.998,28

Quadro 22.



# Relatório de Investimentos – Agosto/2020

## 7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/07/2020	31/08/2020	jun/20	jul/20	ago/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ -	R\$ 522.575,15	-	-	(0,5572)	-0,5572%	(0,0056)	NC	
BRDESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 6.801.000,51	R\$ 7.354.169,94	1,0900	0,9700	0,4200	2,4993%	4,6681%	9,2374%	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 522.267,78	R\$ -							
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 7.323.268,29</b>	<b>R\$ 7.876.745,09</b>							

Quadro 23.

### 7.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV



#### Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: GOVERNO AMAZONAS / AM - TRIBUNALCONTAS2020

09/09/2020 16:29:36

#### Fundo Previdenciário

#### Cálculo Posicionado em 31/08/2020

Mês/Ano	Rccitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
			<b>Saldo Financeiro em 31/08/2019</b>
			<b>1.350.454,95</b>
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
05/2020	446.927,24	0,00	446.927,24
06/2020	447.429,30	0,00	447.429,30
07/2020	522.267,78	0,00	522.267,78
08/2020	522.585,60	0,00	522.585,60
			<b>Saldo Financeiro em 31/08/2020</b>
			<b>7.876.745,09</b>

#### 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	2,4383 %	0,6994 %	0,2400 %
Juros	5,8800 %	3,8826 %	0,4773 %
Meta	8,4617 %	4,6091 %	0,7184 %
Rentabilidade %	8,5832 %	5,1350 %	0,4218 %
Rentabilidade R\$	359.372,43	273.034,10	30.891,20
Resultado %	+0,1120 %	+0,5027 %	-0,2945 %
Resultado R\$	+5.039,27	+27.884,99	-21.720,31

Quadro 24.

# Relatório de Investimentos – Agosto/2020

## 8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV



### Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - CALCULOATUARIAL2020

10/09/2020 13:30:03

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 31/08/2020	
		Saldo Financeiro em 31/08/2019	4.853.514.048,15
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
09/2019	51.923.350,05	2.305.655,41	49.617.694,64
10/2019	48.634.602,75	2.318.685,20	46.315.917,55
11/2019	46.373.444,19	1.152.924,58	45.220.519,61
12/2019	90.119.100,38	2.223.722,41	87.895.377,97
01/2020	37.411.197,30	2.352.695,68	35.058.501,62
02/2020	54.996.430,46	5.174.174,42	49.822.256,04
03/2020	49.389.851,69	13.284.323,18	36.105.528,51
04/2020	48.215.833,84	99.228.317,87	-51.012.484,03
05/2020	48.840.726,03	23.803.184,65	25.037.541,38
06/2020	38.120.534,15	150.324.356,08	-112.203.821,93
07/2020	38.874.890,07	128.068.311,15	-89.193.421,08
08/2020	45.682.773,56	99.044.784,20	-53.362.010,64
		Saldo Financeiro em 31/08/2020	5.043.328.020,63

#### 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	2,4383 %	0,6994 %	0,2400 %
Juros	5,8800 %	3,8826 %	0,4773 %
Meta	8,4617 %	4,6091 %	0,7184 %
Rentabilidade %	2,3849 %	-3,0334 %	-0,9079 %
Rentabilidade R\$	120.512.372,84	-163.863.462,17	-46.697.351,64
Resultado %	-5,6027 %	-7,3058 %	-1,6147 %
Resultado R\$	-306.974.162,63	-412.874.708,63	-83.648.254,12

Quadro 25.

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

**Nota 2:** Os lançamentos das Despesas foram revisados para inclusão do pagamento do FTEMP entre os meses de abril a agosto/2020. A correção foi necessária para ajustar os resultados do FPREV uma vez que esses recursos são utilizados como Despesas Previdenciárias.



## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

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

#### 9.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/07/2020	31/08/2020
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 24.001.010,28	R\$ 29.075.852,33
FUNDO BRADESCO FIC FI RF ALOC. DINÂMICA - COMPREV	R\$ 4.868.573,00	R\$ 4.911.698,06
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 0,02	R\$ 376,03
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 34.865,65	R\$ 34.865,65
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 139.867,37	R\$ 130.774,90
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 29.044.317,32</b>	<b>R\$ 34.153.566,97</b>

Quadro 26.

**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 Previdenciário Militares

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/07/2020	31/08/2020
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R\$ -	R\$ 2.988,94
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R\$ 7.176.957,12	R\$ -
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FTEMP	R\$ -	R\$ 32.945.693,80
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ 11.957.369,81	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 19.134.326,93</b>	<b>R\$ 32.948.682,74</b>

Quadro 27.

**Nota:** Com base nos termos da LC 206/2020 que, dentre outros, cria o Fundo Temporário - FTEMP a partir dos recursos de contribuição dos servidores militares do FPREV, com finalidade de pagamento dos inativos e pensionistas do FFIN e do FPPM. O valor de disponibilidade financeira em conta corrente refere-se à valores de Consignação em processo de pagamento, regularizado em agosto/2020.

#### 9.3 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/07/2020	31/08/2020
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ -</b>

Quadro 28.



## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

### 9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/07/2020	31/08/2020
BRABESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 381.050,13	R\$ 377.950,19
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 44.803,99	R\$ 42.539,30
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 265.103,78</b>	<b>R\$ 420.490,49</b>

Quadro 29.

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/07/2020	31/08/2020
BRABESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 767.313,71	R\$ 643.832,86
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ 187.137,40	R\$ 188.566,03
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 954.452,11</b>	<b>R\$ 832.399,89</b>

Quadro 30.

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/07/2020	31/08/2020
BRABESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 5.129.404,57	R\$ 6.143.202,35
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	R\$ 1.527.307,25	R\$ 537.499,43
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE		R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 265.103,78</b>	<b>R\$ 6.680.701,78</b>

Quadro 31.

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/07/2020	31/08/2020
BRABESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 16.444.694,71	R\$ 13.018.257,21
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE		R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 265.103,78</b>	<b>R\$ 13.018.257,21</b>

Quadro 32.



## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

### 10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

#### 10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/07/2020	31/08/2020	jun/20	jul/20	ago/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.190.816,32	R\$ 1.728.561,31	0,1900	0,1700	0,1400	0,5008%	1,9111%	3,1001%	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 40.639.883,89	R\$ 40.413.455,58	0,7496	0,9773	(0,5572)	1,1674%	5,0592%	6,9444%	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00							
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 42.830.701,21</b>	<b>R\$ 42.142.017,89</b>							

Quadro 33.

#### 10.2 Taxa de Administração - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/07/2020	31/08/2020	jun/20	jul/20	ago/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.125.432,20	R\$ 1.161.346,30	0,1900	0,1700	0,1400	0,5008%	1,9111%	3,1001%	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -							
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 1.125.432,20</b>	<b>R\$ 1.161.346,30</b>							

Quadro 34.

#### 10.3 Taxa de Administração - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/07/2020	31/08/2020	jun/20	jul/20	ago/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 679.475,74	R\$ 680.417,06	0,1900	0,1700	0,1400	0,5008%	1,9111%	3,1001%	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -							
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 679.475,74</b>	<b>R\$ 680.417,06</b>							

Quadro 35.

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/07/2020	31/08/2020	jun/20	jul/20	ago/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.082.594,60	R\$ 2.197.924,58	0,1900	0,1700	0,1400	0,5008%	1,9111%	3,1001%	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -							
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 2.082.594,60</b>	<b>R\$ 2.197.924,58</b>							

Quadro 36.

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/07/2020	31/08/2020	jun/20	jul/20	ago/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ 69.883,93	-	-	0,1400	0,1400%	0,1400%	0,1400%	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 0,10							
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ 69.884,03</b>							

Quadro 37.

# Relatório de Investimentos – Agosto/2020

## 11. OUTROS RECURSOS

### 11.1 Tribunal de Justiça do Estado - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/07/2020	31/08/2020	jun/20	jul/20	ago/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TJA	R\$ 191.141.165,75	R\$ 191.325.567,92	0,2592	0,2410	0,0965	0,5978%	2,8302%	4,8500%
BB PREV. RF IRF MI - TJA	R\$ 135.877.642,55	R\$ 135.997.587,19	0,2567	0,2329	0,0882	0,5788%	2,7812%	4,7707%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 51.045.582,21	R\$ 50.591.914,50	0,9486	1,7677	(0,8887)	1,8201%	2,1322%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ -						
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 378.064.391,51</b>	<b>R\$ 377.915.069,61</b>						

Quadro 38.

### 11.2 Tribunal de Contas do Estado - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/07/2020	31/08/2020	jun/20	jul/20	ago/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TCE	R\$ 57.130.319,81	R\$ 57.185.435,93	0,3930	0,2410	0,0965	0,7321%	2,9674%	4,9900%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 51.045.582,21	R\$ 50.591.914,50	0,9486	1,7677	(0,8887)	2,9619%	1,2580%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -						
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 108.175.902,02</b>	<b>R\$ 107.777.350,43</b>						

Quadro 39.

**Nota:** O estudo para verificação da segregação dos recursos do FFIN e FPREV desses órgãos foram finalizados. Os valores referentes aos recursos do FFIN já estão registrados nos itens 9.6 - 9.7 (pág. 22).






# Relatório de Investimentos – Agosto/2020

## 12. ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
TÍTULOS DO TN	R\$ 641.417.025,36	11,47%	10%	100%	art. 7º, inciso I, "a"
<b>TOTAL art. 7º, inciso I, "a"</b>	<b>R\$ 641.417.025,36</b>				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM I FIC FI	R\$ 135.997.587,19				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 6.846.386,96				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 174.834.128,07				
CAIXA FI BRASIL IRF M I TP RF	R\$ 248.511.003,85				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 439.311.958,19				
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ -	33,51%	10%	100%	art. 7º, inciso I, "b"
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 53.071.179,30				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 571.886.729,08				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 56.513.555,53				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 108.641.047,13				
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 77.807.918,49				
<b>TOTAL art. 7º, inciso I, "b"</b>	<b>R\$ 1.873.421.493,79</b>				
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 90.046.787,80				
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 59.219.588,78				
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 126.254.561,65	23,91%	30%	40%	art. 7º, inciso IV, "a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 818.004.969,94				
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 243.195.120,54				
<b>TOTAL art. 7º, inciso IV, "a"</b>	<b>R\$ 1.336.721.028,71</b>				
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 28.411.029,78	0,51%	5%	5%	art. 7º, inciso VII, "b"
<b>TOTAL art. 7º, inciso VII, "b"</b>	<b>R\$ 28.411.029,78</b>				
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>R\$ 3.879.970.577,64</b>	<b>69,40%</b>			

Quadro 40.

## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BRDESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 29.216.686,03	0,94%	10%	30%	art 8º, inciso I, "a"
ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FI	R\$ 23.325.961,45				
<b>TOTAL art 8º, inciso I, "a"</b>	<b>R\$ 52.542.647,48</b>				
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 9.159.400,45	26,42%	30%	30%	art 8º, inciso II, "a"
BRDESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 117.595.402,80				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 83.313.019,03				
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 89.997.160,89				
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 117.796.634,35				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 151.130.951,01				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 47.503.405,69				
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 216.021.797,10				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 275.347.354,89				
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 90.872.219,73				
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$ 42.905.197,45				
SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 63.753.705,28				
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 77.003.842,71				
OCCAM FIC FIA	R\$ 76.986.782,03				
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 17.561.225,84				
<b>TOTAL art. 8º, inciso II, "a"</b>	<b>R\$ 1.476.948.099,25</b>				
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 20.432.900,24	0,37%	1%	3%	art. 8º, inciso III
<b>TOTAL art. 8º, inciso III</b>	<b>R\$ 20.432.900,24</b>				
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$ 1.549.923.646,97</b>	<b>27,72%</b>			

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXTERIOR	R\$ 37.161.387,62	0,66%	2,5%	10%	art 9º, inciso II
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 49.158.658,32	2,21%	2,5%		art 9º, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 74.608.111,20				
<b>TOTAL art 9º - A</b>	<b>R\$ 160.928.157,14</b>				
<b>TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>	<b>R\$ 160.928.157,14</b>	<b>2,88%</b>			
<b>TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES</b>	<b>R\$ 5.590.822.381,75</b>	<b>100,00%</b>			

Quadro 41.

@

  
 26



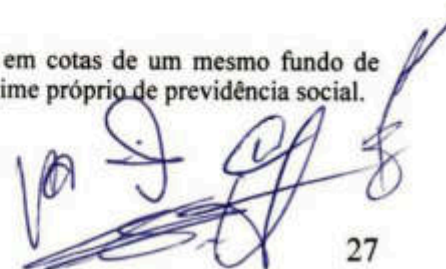
## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% CARTEIRA	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM I FIC FI	RS 135.997.587,19	2,40%	20%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	RS 6.846.386,96	0,12%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	RS 174.834.128,07	3,09%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	RS 818.004.969,94	14,44%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	RS 83.313.019,03	1,47%	
BB FIA BDR - NIVEL I	RS 49.158.658,32	0,87%	
CAIXA FI BRASIL IRF M I TP RF	RS 248.511.003,85	4,39%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	RS 439.311.958,19	7,76%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	RS -	0,00%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	RS 53.071.179,30	0,94%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	RS 90.046.787,80	1,59%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	RS 59.219.588,78	1,05%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	RS 126.254.561,65	2,23%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	RS 29.216.686,03	0,52%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	RS 117.595.402,80	2,08%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	RS 243.195.120,54	4,29%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	RS 571.886.729,08	10,10%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	RS 9.159.400,45	0,16%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	RS 151.130.951,01	2,67%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	RS 47.503.405,69	0,84%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	RS 89.997.160,89	1,59%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	RS 117.796.634,35	2,08%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	RS 216.021.797,10	3,81%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	RS 28.411.029,78	0,50%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	RS 56.513.555,53	1,00%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	RS 108.641.047,13	1,92%	
ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI	RS 23.325.961,45	0,41%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	RS 275.347.354,89	4,86%	
SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES	RS 63.753.705,28	1,13%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	RS 90.872.219,73	1,60%	
SANTANDER SELEÇÃO 30	RS 42.905.197,45	0,76%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	RS 37.161.387,62	0,66%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	RS 20.432.900,24	0,36%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	RS 77.807.918,49	1,37%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	RS 74.608.111,20	1,32%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	RS 77.003.842,71	1,36%	
OCCAM FIC FIA	RS 76.986.782,03	1,36%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	RS 17.561.225,84	0,31%	
<b>TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO</b>	<b>RS 4.949.405.356,39</b>		

Quadro 42.

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





## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

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

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14	TOTAL APLICADO	CNPJ	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL DO FUNDO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 135.997.587,19	11.328.882/0001-35	R\$ 7.749.783.927,00	1,75%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	R\$ 6.846.386,96	19.523.305/0001-06	R\$ 238.494.074,76	2,87%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 174.834.128,07	13.327.340/0001-73	R\$ 1.987.566.192,50	8,80%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 818.004.969,94	25.078.994/0001-90	R\$ 10.897.747.304,91	7,51%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 83.313.019,03	29.258.294/0001-38	R\$ 901.803.096,40	9,24%	
BB FIA BDR - NÍVEL I	R\$ 49.158.658,32	21.470.644/0001-13	R\$ 494.486.681,98	9,94%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 90.046.787,80	08.246.263/0001-97	R\$ 508.138.601,17	17,72%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 59.219.588,78	20.216.216/0001-04	R\$ 770.238.550,30	7,69%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 126.254.561,65	28.515.874/0001-09	R\$ 1.372.728.315,02	9,20%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 29.216.686,03	14.099.976/0001-78	R\$ 193.758.581,06	15,08%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 117.595.402,80	06.988.623/0001-09	R\$ 2.138.016.152,06	5,50%	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 248.511.003,85	10.740.670/0001-06	R\$ 10.245.504.415,30	2,43%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 439.311.958,19	11.060.913/0001-10	R\$ 12.740.710.327,20	3,45%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ -	22.791.028/0001-27	R\$ -	0,00%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 53.071.179,30	22.791.074/0001-26	R\$ 216.582.450,56	24,50%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 571.886.729,08	23.215.097/0001-55	R\$ 13.462.808.031,45	4,25%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 89.997.160,89	10.577.512/0001-79	R\$ 750.936.914,19	11,98%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 243.195.120,54	21.838.150/0001-49	R\$ 5.008.664.363,26	4,86%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 9.159.400,45	08.817.414/0001-10	R\$ 832.932.613,38	1,10%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 117.796.634,35	23.731.629/0001-07	R\$ 1.780.436.467,38	6,62%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 151.130.951,01	24.571.992/0001-75	R\$ 3.382.143.848,22	4,47%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 47.503.405,69	01.063.897/0001-65	R\$ 1.220.694.857,73	3,89%	
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$ 42.905.197,45	29.549.642/0001-26	R\$ 1.579.203.818,56	2,72%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 63.753.705,28	02.436.763/0001-05	R\$ 576.020.291,87	11,07%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 90.872.219,73	01.699.688/0001-02	R\$ 806.876.353,28	11,26%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 37.161.387,62	17.804.792/0001-50	R\$ 684.564.344,94	5,43%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 216.021.797,10	08.279.304/0001-41	R\$ 1.500.161.277,42	14,40%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 56.513.555,53	10.922.432/0001-03	R\$ 607.086.738,61	9,31%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 108.641.047,13	10.756.541/0001-06	R\$ 995.565.477,80	10,91%	
ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI	R\$ 23.325.961,45	06.224.719/0001-92	R\$ 151.867.785,44	15,36%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 77.807.918,49	30.659.168/0001-74	R\$ 1.759.993.204,58	4,42%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 275.347.354,89	11.977.794/0001-64	R\$ 2.421.513.673,79	11,37%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NÍVEL I	R\$ 74.608.111,20	19.436.818/0001-80	R\$ 1.489.928.271,86	5,01%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 77.003.842,71	34.791.108/0001-61	R\$ 506.153.658,08	15,21%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 76.986.782,03	11.628.883/0001-03	R\$ 837.203.437,34	9,20%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 17.561.225,84	11.458.144/0001-02	R\$ 1.159.474.801,39	1,51%	
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 4.900.561.426,37</b>				

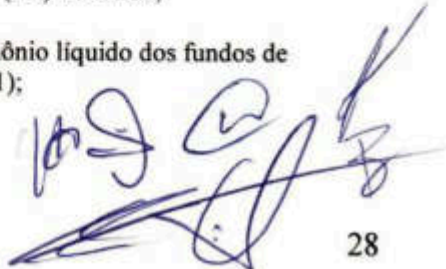
FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14, § 1º	TOTAL APLICADO	CNPJ	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Resolução CMN nº 3.922/2010
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 20.432.900,24	21.595.829/0001-54	537.917.191,45	3,80%	5%
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 28.411.029,78	19.719.727/0001-51	637.780.252,66	4,45%	
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 48.843.930,02</b>				

<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 4.949.405.356,39</b>
--------------	-----------------------------

Quadro 43.

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

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





## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

**Nota 3:** Art. 14 § 3º. Em caso de os limites de que tratam o caput e o § 1º deste artigo serem ultrapassados em decorrência de resgate de cotas do fundo por outros cotistas, o regime próprio de previdência social deverá adequar-se em até 120 dias. Conforme observado no fundo Icatu Vanguarda IBx FI e fundo Bradesco Inst. IBRx Alpha.

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

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA JULHO/2020) EM R\$ M1	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (AGOSTO/2020)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB DTVM S.A	R\$ 1.130.039,87	R\$ 1.268.154.749,51	0,1122%	5%
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 734.084,20	R\$ 568.785.512,04	0,0775%	
BRADESCO	R\$ 520.945,63	R\$ 422.333.027,06	0,0811%	
CAIXA	R\$ 382.241,57	R\$ 1.402.778.031,31	0,3670%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	R\$ 292.885,75	R\$ 234.692.510,08	0,0801%	
BANCO BTG	R\$ 122.869,75	R\$ 275.347.354,89	0,2241%	
BANCO SAFRA	R\$ 100.772,08	R\$ 172.848.929,93	0,1715%	
SULAMERICA INVESTIMENTOS	R\$ 31.488,04	R\$ 17.561.225,84	0,0558%	
ICATU VANGUARDA DTVM S/A	R\$ 28.301,52	R\$ 432.913.390,99	1,5296%	
AZ QUEST	R\$ 15.827,20	R\$ 77.003.842,71	0,4865%	
OCCAM BRASIL	R\$ 11.506,35	R\$ 76.986.782,03	0,6691%	

Quadro 44.

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

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

### DISTRIBUIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR GESTOR DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS

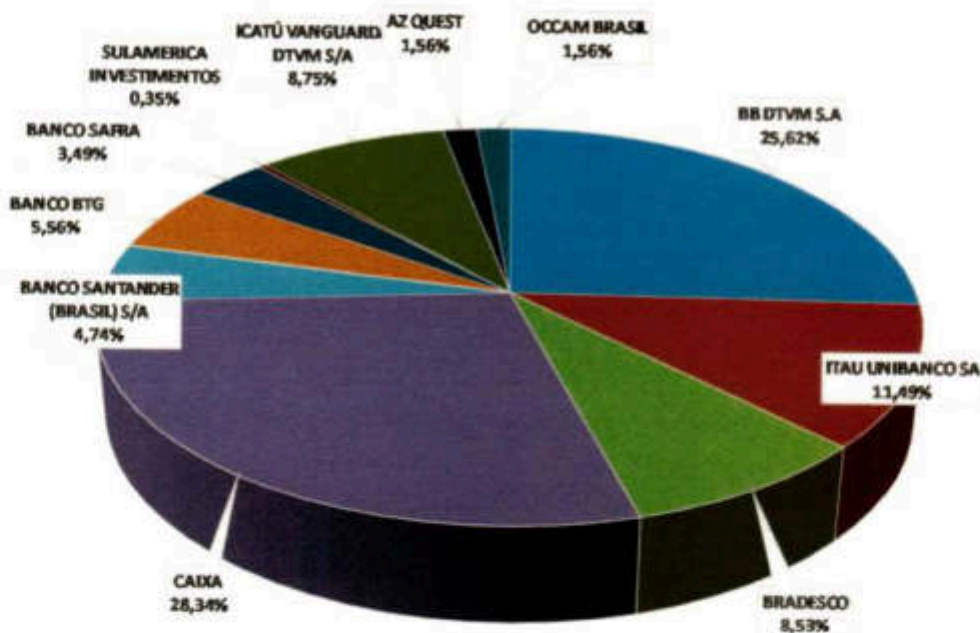


Gráfico 4.

  
 29

## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

### 13. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.949.405.356,39
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 641.417.025,36
TÍTULOS PÚBLICOS - CVS	R\$ 11.029.134,48
IMÓVEIS	R\$ 60.353.005,55
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1.121.607,83
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 5.663.326.129,61</b>

Quadro 45.

### EVOLUÇÃO DOS RECURSOS - AMAZONPREV

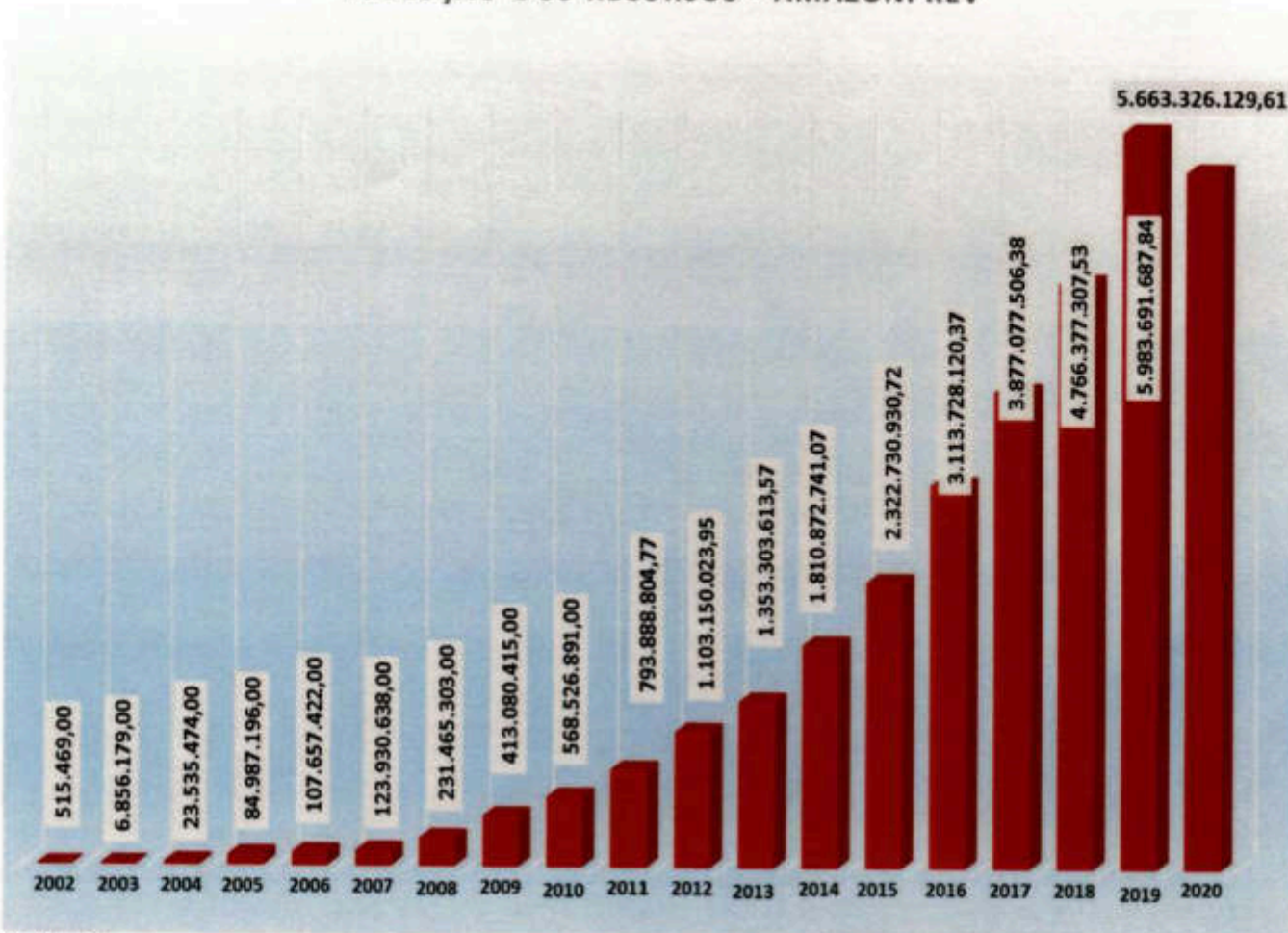


Gráfico 5.

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



## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

### 14. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
<b>FPREV EXECUTIVO:</b>	Direcionar para o fundo BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO (17.413.636/0001-68)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2020
<b>FPREV ALE:</b>	<b>Novos Recursos:</b> Direcionar para ICATU VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP (19.719.727/0001-51)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2020
	<b>Recursos Atuais:</b> Zerar aplicação no fundo Itaú Alocação Dinâmica, direcionando para o fundo SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2020
<b>FPREV MPE/PGJ:</b>	<b>Novos Recursos:</b> Direcionar para o FundoFI Brasil Caixa Gestão Estratégica	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2020
<b>FPREV - DPE/AM</b>	<b>Novos Recursos:</b> Direcionar para o FundoFI Brasil Caixa Gestão Estratégica	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2020
<b>FPREV - TJ/AM</b>	<b>Novos Recursos:</b> Direcionar para o Fundo FI Brasil Caixa Gestão Estratégica	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2020
<b>FPREV - TCE/AM</b>	<b>Novos Recursos:</b> Direcionar para o Fundo FI Brasil Caixa Gestão Estratégica	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2020
<b>FFIN (Executivo, ALE, TCE, TJA, MPE, DPE)</b>	Aplicar os recursos no fundo Bradesco Maxi Poder Público, facilitando a operacionalização dos pagamentos das folhas de inativos e pensionistas desses órgãos. Devem ser observados os limites para aplicação conforme legislação vigente.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2020
<b>RECURSOS COMPREV</b>	Manter os recursos aplicados no fundo Bradesco Alocação Dinâmica, de forma manter o enquadramento dos recursos da Amazonprev	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2020
<b>DISPONIBILIDADES DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b>	1. Poder Executivo: Manter o fundo Maxi poder Público, direcionando o residual, se houver, para o Fundo Caixa Gestão Estratégica. 2. Aos valores repassados pelos demais órgãos deve-se direcionar para o fundo Bradesco Alocação Dinâmica, com a justificativa que se trata de fundo com Gestão Ativa, por esse motivo deve manter resultado acima do CDI no Longo Prazo. Havendo necessidade, a GERAF/COFIN pode solicitar transferência de valores da Caixa para o Bradesco.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2020
<b>REUNIÃO COM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</b>	Realização de Reunião por video Conferência com as instituições Gestoras de Fundos de Investimentos, além dos economistas das instituições, para discussões sobre os resultados e preparativos para a Política de Investimentos para 2021.	COMIV	15/10/2020

Quadro 46.

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



GOVERNO DO ESTADO DO AMAZONAS



**AMAZONPREV**  
Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



**RELATÓRIOS - 2020**

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





# Relatório de Investimentos – Agosto/2020

SALDOS E PERFORMANCE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO - FPREV AMAZONPREV	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL DO FUNDO	COTA DO FECHAMENTO MÊS	Volatilidade 12M	Var 95% 12M	Max Drawdown 12M	12M	ago/20	2020
BB Prev RF Alceano Ativa FcII	R\$ 716.821.140,94	R\$ 10.897.747.204,91	6,38%	1,492070	1,15%	0,63%	-5,49	6,05%	-0,80%	2,63%
BB Prev RF TR Publ VII FI	R\$ 6.846.386,96	R\$ 238.494.074,76	2,87%	1,784052	0,66%	0,23%	-2,66	6,06%	0,47%	2,45%
BB Prev RF Imo-BS+ Tp FI	R\$ 174.834.128,07	R\$ 1.987.566.192,50	8,80%	3,322636	4,71%	1,99%	-4,84	4,54%	-3,69%	-2,23%
Bradesc Fc FI RF Alceano Dinamica	R\$ 122.475.273,13	R\$ 1.372.728.315,02	8,92%	1,263696	1,16%	0,69%	-5,88	6,03%	-0,80%	2,63%
Bradesc Inst FICFI RF Imo B 5	R\$ 58.087.179,24	R\$ 770.238.550,30	7,54%	1,991067	1,01%	0,55%	-5,66	9,22%	0,42%	4,68%
Bradesc FI RF Maxo Poder Publico	R\$ 2.000.876,94	R\$ 508.138.601,17	0,39%	3,429323	0,10%	0,01%	0,00	3,57%	0,14%	1,92%
Caixa FI Brasil 2020 V Tp RF	R\$ -	R\$ -			0,96%		-0,12			
Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	R\$ 53.071.179,30	R\$ 216.582.450,56	24,50%	1,534275	1,89%	0,94%	-10,12	5,84%	-2,48%	0,66%
FI Caixa Brasil Imo B 5 Tp RF LP	R\$ 439.311.958,19	R\$ 12.740.710.327,20	3,45%	3,130128	0,99%	0,51%	-5,40	8,93%	0,59%	4,45%
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	R\$ 531.473.273,50	R\$ 13.462.808.031,45	3,95%	1,491577	0,78%	0,61%	-4,27	9,21%	-0,50%	5,06%
Icatu Vang FI RF Indicao Cred Priv LP	R\$ 28.411.029,78	R\$ 637.780.252,66	4,45%	2,163123	1,72%	0,61%	-6,53	7,36%	0,55%	3,78%
Icatu Vanguardia Indicao Certa FI RF LP	R\$ 56.513.555,53	R\$ 607.086.738,61	9,31%	3,480928	1,02%	0,53%	-5,56	8,97%	0,33%	4,45%
Icatu Vang Indicao Longa FI RF LP	R\$ 108.641.047,13	R\$ 995.565.477,80	10,91%	4,288215	4,75%	2,00%	-4,89	4,38%	-3,66%	-2,39%
Itaú Inst Alceano Dinamica RF FICFI	R\$ 243.195.120,54	R\$ 5.008.664.363,26	4,86%	17,998259	0,22%	0,17%	-1,57	4,74%	-0,12%	2,70%
Safra Imo Institucional Fc FI RF	R\$ 77.807.918,49	R\$ 1.759.993.204,58	4,42%	131,304967	3,04%	1,47%	-13,28	8,56%	-2,03%	2,16%
Santander RF Ativo Fc FI	R\$ -	R\$ 1.131.802.857,33	0,00%	12,748904	0,59%	0,14%	-0,55	6,43%	-0,35%	2,16%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 2.619.490.067,74</b>									

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	COTA DO FECHAMENTO MÊS	Volatilidade 12M	Var 95% 12M	Max Drawdown 12M	12M	ago/20	2020
BB Acoes Valor Fc FIA	R\$ 83.313.019,03	R\$ 901.803.096,40	9,24%	1,260658	10,76%	4,14%	-5,09	-2,66%	-3,55%	-15,94%
BB FIA Bdr Nivel I	R\$ 49.158.658,32	R\$ 494.486.681,98	9,94%	4,304948	5,85%	2,70%	-17,19	66,30%	14,82%	51,35%
Bradesc FIA Mid Small Caps	R\$ 117.595.402,80	R\$ 2.138.016.152,06	5,50%	10,567974	12,85%	4,36%	-3,20	6,20%	-1,58%	-10,08%
Brad Fc de FIA Institucional Ibox Alpha	R\$ 29.216.686,03	R\$ 193.758.581,06	15,08%	1,947214	12,19%	4,37%	-4,39	4,47%	-2,94%	-11,92%
BTG Precial Absoluto Inst FIC FIA	R\$ 275.347.354,89	R\$ 2.421.513.673,79	11,37%	4,524296	13,07%	4,55%	-3,60	10,14%	-0,43%	-1,08%
Caixa FIA Consumo	R\$ 89.997.160,89	R\$ 750.936.914,19	11,98%	1,999211	13,09%	4,56%	-5,29	5,57%	-1,59%	-6,25%
Icatu Vanguardia Acoes Ibox FI	R\$ 23.325.961,45	R\$ 151.867.785,44	15,36%	6,869747	12,33%	4,49%	-5,03	0,10%	-2,97%	-12,62%
Icatu Vanguardia Dividendos FIA	R\$ 216.021.797,10	R\$ 1.500.161.277,42	14,40%	4,760987	11,14%	3,95%	-4,87	-10,03%	-4,69%	-20,32%
Itaú Acoes Dinamica Fc	R\$ 151.130.951,01	R\$ 3.382.143.848,22	4,47%	19,817862	12,89%	4,36%	-3,26	-2,64%	-0,20%	-16,55%
Itaú Rpt Acoes Ibovespa Ativo FICFI	R\$ 9.159.400,45	R\$ 832.932.613,38	1,10%	2,791397	12,51%	4,40%	-4,01	0,98%	-3,01%	-12,28%
Itaú Institucional Acoes Phoenix Fc FI	R\$ 117.796.634,35	R\$ 1.780.436.467,38	6,62%	21,191703	16,95%	5,16%	-4,10	-17,17%	-3,92%	-27,34%
Itaú Small Cap Master FIA	R\$ 47.503.405,69	R\$ 1.417.382.544,12	3,35%	13,692964	14,29%	4,65%	-3,78	5,38%	-0,82%	-15,76%
Santander FICFI Selecao Top Acoes	R\$ 63.753.705,28	R\$ 576.020.291,87	11,07%	25,987427497	13,28%	4,29%	-4,44	-6,17%	-1,81%	-17,46%
Santander FI Ibovespa Ativo Inst Acoes	R\$ 90.872.219,73	R\$ 806.876.353,28	11,26%	16,7898415	13,19%	4,49%	-4,89	-5,43%	-2,91%	-17,75%
Santander Selecao 30 Acoes Fc	R\$ 42.905.197,45	R\$ 1.579.203.818,56	2,72%	25,835.112078	13,26%	4,29%	-4,47	-6,24%	-1,81%	-17,50%
Santander FI Global Equities Multi Je	R\$ 37.161.387,62	R\$ 684.564.344,94	5,43%	39,911097	5,36%	2,25%	-19,06	64,75%	11,85%	53,98%
Safra S P Reais Pb FI Multi	R\$ 20.432.900,24	R\$ 587.917.191,45	3,80%	228,809490	6,69%	3,22%	-34,78	18,01%	6,86%	6,19%
Safra Consumo Americano FIA Bdr Nivel I	R\$ 74.603.333,39	R\$ 1.489.928.271,86	5,01%	590,923945	6,08%	3,19%	-22,47	53,66%	16,00%	46,26%
Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	R\$ 77.003.842,71	R\$ 506.153.658,08	15,21%	0,962559	11,08%	4,16%	-4,78	0,61%	-2,24%	-12,76%
Occum Fc de FIA	R\$ 76.986.782,03	R\$ 837.203.437,34	9,20%	3,023554	11,08%	4,16%	-4,78	0,61%	-2,24%	-12,76%
Sul America Equities FIA	R\$ 17.561.225,84	R\$ 1.159.474.801,39	1,51%	17,607079	15,59%	4,74%	-4,16	-6,35%	-2,03%	-19,01%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 1.710.847.026,30</b>									
<b>TOTAL GERAL</b>	<b>R\$ 4.330.337.094,04</b>									

Quadro 1.

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



## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

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

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

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

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

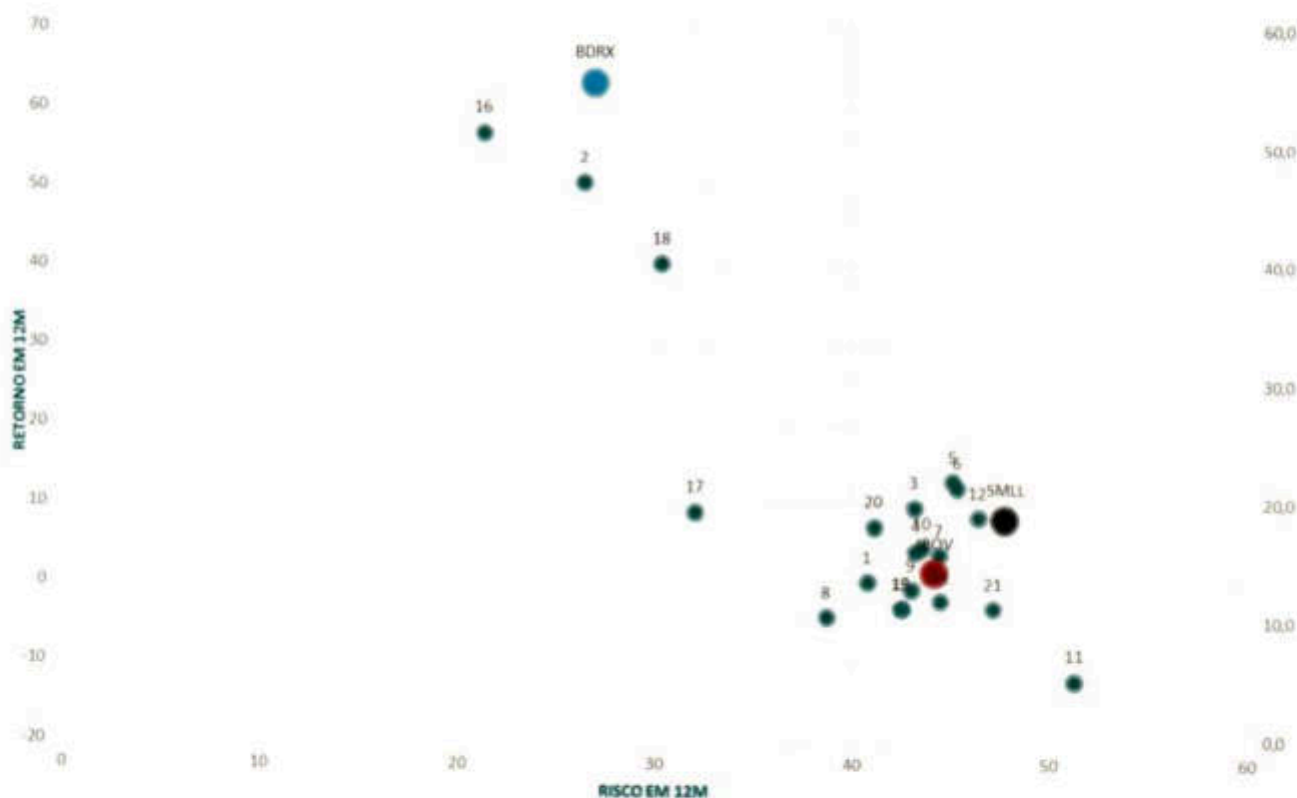


Gráfico 1: Análise Risco x Retorno (12 M)



## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

Nº	Fundos	Retorno	Volatilidade
1	BB Acoes Valor Fc FIA	0,02	40,77
2	BB FIA Bdr Nivel I	50,49	26,42
3	Bradesco FIA Mid Small Caps	9,43	43,13
4	Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	3,89	43,20
5	BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	12,75	45,07
6	Caixa FIA Consumo	11,99	45,31
7	Icatu Vanguarda Acoes Ibx FI	3,47	44,38
8	Icatu Vanguarda Dividendos FIA	-4,41	38,68
9	Itau Acoes Dunamis Fc	-0,92	42,98
10	Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	4,36	43,53
11	Itau Institucional Acoes Phoenix Fc FI	-12,43	51,24
12	Itau Small Cap Master FIA	8,20	46,36
13	Santander FICFI Selecao Top Acoes	-3,26	42,52
14	Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes	-2,38	44,45
15	Santander Selecao 30 Acoes Fc	-3,36	42,46
16	Santander FI Global Equities Mult Ie	56,85	21,31
17	Safra S P Reais Pb FI Mult	8,83	32,03
18	Safra Consumo Americano FIA Bdr Nivel I	40,24	30,34
19	Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA		
20	Occam Fc de FIA	7,01	41,10
21	Sul America Equities FIA	-3,34	47,14

Quadro 2. Legenda Gráfico 1.

## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

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

DATA BASE EM 31.08.20

TABELA - DURATION & YIELD POR CLASSE			
Ativo	Duration	Spread	% PL
DEB	3,28	2,21%	56,1%
CRI	0,00	0,00%	0,0%
LF	2,17	1,40%	9,6%
CDB	0,13	0,74%	0,9%
DPGE	0,00	0,00%	0,0%
NP	1,82	1,80%	1,1%
FIDC	0,00	0,00%	0,0%
NTN-B	4,13	-	20,2%
Over	0,00	-	12,1%
<b>Carteira Crédito</b>	<b>3,06</b>	<b>2,07%</b>	<b>67,7%</b>
<b>Crédito - Contribuição Fundo</b>	<b>0,92</b>	<b>1,40%</b>	<b>67,7%</b>
<b>Fundo (Inclui DAP e NTN-B)</b>	<b>2,40</b>	<b>1,40%</b>	<b>100,0%</b>

TABELA - RATING EXTERNO*		
Rating	Financeiro	% PL
AAA	136.666.628	21,4%
AA+	77.074.100	12,1%
AA	93.462.533	14,6%
AA-	28.492.941	4,5%
A+	45.858.065	7,2%
DPGE	0	0,0%
A	7.176.245	1,1%
A-	8.257.301	1,3%
BBB+	14.904.467	2,3%
BBB	0	0,0%
BBB-	6.163.005	1,0%
BB+	0	0,0%
BB	0	0,0%
BB-	8.975.239	1,4%
B+	0	0,0%
B	0	0,0%
B-	0	0,0%
CCC	0	0,0%
CC	0	0,0%
C	0	0,0%
Sem Limite	4.749.392	0,7%
Tesouro / Over	206.244.785	32,3%
<b>Total</b>	<b>638.024.701</b>	<b>100,0%</b>

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

Quadro 03.



## Relatório de Investimentos – Agosto/2020

TABELA - SETOR		
Setor	Financeiro	% PL
Elétrico	120.332.056	18,9%
Bancos	66.428.595	10,4%
Conc. Rodoviárias	61.296.878	9,6%
Saneamento	57.384.969	9,0%
Serviço	34.427.142	5,4%
Varejo	20.230.140	3,2%
Shopping Center	19.490.180	3,1%
Óleo e Gás	16.645.142	2,6%
Holding	12.758.938	2,0%
Mineração e Siderurgia	8.629.934	1,4%
Logística	7.613.828	1,2%
Papel e Celulose	4.071.241	0,6%
Infraestrutura	2.470.873	0,4%
Tesouro / Over	206.244.785	32,3%
<b>Total</b>	<b>638.024.701</b>	<b>100,0%</b>

Quadro 04.

**Nota:** Dados referentes ao fundo ICATU VANGUARDA FI RF INFLACÃO CREDITO PRIVADO LP. (base: 31/08/2020)

## **PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS**

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 15 de setembro de 2020, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de agosto/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, com base nas Atas de Reunião do Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev.

Manaus – AM, 15 de setembro 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:

**APROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL - CONAD**

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

(  ) APROVAÇÃO

(  ) REJEIÇÃO

Data:

Membros do Conselho de Administração: