

Relatório de Investimentos abril de 2018

Destino: DIRAF / PRESI

Assunto: **Relatório de Investimentos – abril/2018**

Data: 17/05/2018

RELATÓRIO N°. 013/ 2018 – COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **abril/2018**, destacando:

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 03 a 05);
- 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 e Recursos Consolidados do FPREV (páginas 06 a 16);
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário FPREV/ALEAM (páginas 16 a 17);
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado – FPREV Executivo e ALE (páginas 17 A 18);
- 5) Recursos do Fundo Financeiro Executivo – FFIN - (páginas 17 a 18);
- 6) Recursos da Taxa de Administração - (página 19);
- 7) Recursos dos Outros Poderes: Saldos e Composição por órgão – TCE e TJA (página 20);
- 8) Enquadramento das Aplicações Financeiras, com base na legislação vigente (páginas 21 a 23);
- 9) Consolidado e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 24 a 26).

Relatório de Investimentos abril de 2018

1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

SÍNTESE ECONÔMICA DE ABRIL

A economia teve desempenho modesto em fevereiro e cresceu ligeiramente na margem, o que reforçou a expectativa de crescimento moderado no primeiro trimestre. O índice de atividade do BC (IBC-BR), que é uma proxy do PIB mensal, cresceu 0,1% na margem em fevereiro, e ficou ligeiramente acima da mediana das expectativas, que era de estabilidade para o indicador. O resultado confirmou o fraco desempenho da economia que já havia sido sinalizado nas vendas do varejo, na produção industrial e no setor de serviços. Na comparação anual, o IBC-BR registrou alta de 0,7%, e considerando o bimestre janeiro e fevereiro, o indicador registrou alta de 1,8% na comparação anual. Esse desempenho anual seria compatível com a economia crescendo 0,5% no primeiro trimestre. Nossa avaliação é que a frustração dos indicadores de janeiro e fevereiro, juntamente com a nossa expectativa para o desempenho da economia em março, deverá resultar num crescimento moderado no início desse ano, e assim revisamos nossa expectativa de crescimento do primeiro trimestre de 0,5% para 0,2% na margem, o que é compatível com alta de 1,4% em termos anuais. Para 2018, revisamos nossa projeção de crescimento de 3% para 2,4%.

A inflação surpreendeu favoravelmente na prévia de abril, e indica que o cenário inflacionário benigno permanece nesse início de segundo de trimestre. O IPCA-15 registrou alta de 0,21% em abril, e ficou abaixo da nossa projeção e da mediana das expectativas de mercado, que era de 0,25%. A inflação acumulada em 12 meses ficou estável em 2,8% em abril. A forte alta dos preços de administrados foi compensada pela menor inflação de itens livres. A inflação de administrados foi pressionada pelos aumentos de energia elétrica, gasolina e medicamentos. No caso da inflação de preços livres, a alimentação em domicílio, aluguel e passagens áreas tiveram variações menores que o esperado. A média dos núcleos de inflação manteve comportamento benigno e ficou estável em 3,2% em termos anuais. O índice de difusão também segue favorável e desacelerou de 55,1% em março para 49,9% em abril. Para o ano, esperamos que o IPCA encerre com variação de 3,3%.

Nos EUA, o PIB do primeiro trimestre surpreendeu positivamente. O crescimento na margem anualizado (SAAR) foi de 2,3%, acima da mediana do mercado de 2%, o que representou uma desaceleração em relação ao último trimestre do ano passado (2,9% SAAR).

Relatório de Investimentos abril de 2018

Em sua composição, o PIB norte-americano mostrou uma expansão de 1,1% SAAR no consumo, ante crescimento de 4% SAAR no trimestre anterior, e expansão de 7,3% SAAR do investimento, ante crescimento de 4,7% SAAR no quarto trimestre. No decorrer desse ano, a implementação do pacote fiscal deverá impulsionar adicionalmente a atividade, elevando o PIB SAAR para 3%. Esse cenário de impulso adicional de crescimento sob uma condição de pleno emprego deverá resultar em aumento da pressão inflacionária, sancionando o nosso cenário de mais três elevações da taxa de juros nesse ano.

Na Zona do Euro, o Banco Central (BCE) manteve a política monetária. Conforme o esperado, o BCE manteve a taxa principal de juros em zero e a taxa de depósito negativa em 0,4% a.a. Já a taxa de empréstimos segue em 0,25% a.a. Nessa mesma linha, o programa de compra de títulos foi mantido em 30 bilhões de euros até setembro. Com poucas alterações no discurso, o presidente do BCE, Mário Draghi, fez questão de ressaltar que segue confiante com o cenário de crescimento robusto na região, apesar de reconhecer uma moderação recente na margem. Em virtude da expectativa de melhoras nos próximos dados de atividade, mantemos a expectativa de que o programa de compra de títulos não será postergado para além de setembro. A respeito da dinâmica de atividade, os dados preliminares de confiança em abril apontaram uma interrupção da piora ocorrida no primeiro trimestre. O PMI composto da região ficou estável em 55,2 pontos, após três quedas consecutivas. Extrapolando os números recente para obter uma estimativa do PIB, após um crescimento consolidado de 0,6% no último trimestre de 2017, devemos observar uma desaceleração do crescimento para 0,3% no primeiro trimestre de 2018, e uma retomada para 0,5% no segundo trimestre.

Na China, os indicadores de atividade de março foram mais fracos, porém o crescimento da economia no primeiro trimestre ficou dentro do esperado. A economia chinesa cresceu 6,8% no primeiro trimestre em termos anuais, e foi beneficiada pelo forte crescimento do consumo e a recuperação dos investimentos privados que compensaram a queda das exportações líquidas. O consumo contribuiu com 5,3 p.p e foi o principal componente para o resultado pela ótica da demanda. O investimento contribuiu com 2,1 p.p para o resultado do PIB do primeiro trimestre frente a contribuição de 1,7 p.p no quarto trimestre. As exportações líquidas tiveram contribuição negativa de 0,6 p.p, devido ao crescimento das importações mais rápido do que das exportações. Os indicadores de atividade de março foram mais fracos que o esperado com a produção industrial e os investimentos em ativos fixos crescendo mais

Relatório de Investimentos abril de 2018

lentamente. O sinal mais favorável dos indicadores de março foi o resultado das vendas do varejo que cresceram 10,1% em termos nominais na comparação anual, e indica que o mercado de trabalho robusto está compensando o aperto do crédito para o consumo feito pelo governo.

Fonte: CENÁRIO ECONÔMICO – Departamento de Pesquisas e Estudos Econômicos – BRAM – Bradesco Asset Management.

Relatório de Investimentos abril de 2018

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO %					
	29/03/2018	30/04/2018	fev/18	mar/18	abr/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 375.713.214,00	R\$ 242.027.266,98	0,4897	0,5198	0,5059	1,5231%	2,1074%	8,3600%
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 224.836.128,98	R\$ 225.960.776,84	0,4454	0,5176	0,4999	1,4701%	2,0461%	NC
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ -	R\$ 70.421.267,84	-	-	0,6018	0,6018%	0,6018%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF M1 TP RF	R\$ 327.042.615,75	R\$ 168.454.481,38	0,5339	0,6392	0,4879	1,6701%	2,2494%	8,7555%
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	R\$ 70.915.878,73	R\$ 71.388.704,47	0,6332	0,7299	0,6659	2,0426%	3,0947%	8,7700%
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF	R\$ 42.479.247,42	R\$ 42.873.033,13	0,5388	1,6356	0,9254	3,1288%	4,2238%	11,8700%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 45.908.096,40	R\$ 45.774.957,96	0,4215	2,1918	(0,2869)	2,3281%	5,4376%	12,0800%
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO	R\$ 5.156.789,71	R\$ 5.183.980,90	1,1803	1,9327	0,5273	3,6796%	3,6796%	NC
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 15.851.112,75	R\$ 200.846.057,50	0,0830	1,1769	0,3299	1,5949%	1,5949%	NC
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 404.034.041,41	R\$ 427.816.907,11	-	1,0085	0,4053	1,4179%	1,4179%	NC
SANTANDER FIC FI INST. RF REF DI	R\$ 100.240.254,56	R\$ 100.749.882,29	0,4373	0,5319	0,5084	1,4848%	2,0765%	NC
SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	R\$ 152.408.711,15	R\$ 153.019.356,67	-	1,6058	0,4007	2,0129%	2,0129%	NC
BB PREVID RF IRF M1	R\$ 657.763.745,00	R\$ 660.920.765,23	0,5244	0,6338	0,4799	1,6470%	2,2253%	8,7057%
BB PREVID TP VII	R\$ 31.159.674,54	R\$ 31.338.335,41	0,4589	1,2658	0,5733	2,3137%	3,5127%	10,5719%
BB PREVID TP IX	R\$ 8.490.290,96	R\$ 8.525.475,97	0,2434	0,5725	0,4144	1,2351%	2,2854%	8,2166%
BB PREVID IDKA 2	R\$ 201.751.681,25	R\$ 235.283.258,83	-	0,8758	0,6907	1,5726%	1,5726%	NC
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI FI	R\$ 124.482.050,29	R\$ 74.894.115,74	0,4538	0,5168	0,5048	1,4827%	2,0483%	7,9900%
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 70.655.047,24	R\$ 135.804.667,24	0,7525	1,0283	0,3257	2,1200%	3,6169%	NC
TOTAL	R\$ 2.858.888.580,14	R\$ 2.901.283.291,49						

Quadro 1

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

2.2 EVOLUÇÃO DOS SALDOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXECUTIVO

INSTITUIÇÃO	fev/18	mar/18	mar/18
BRADESCO	R\$ 598.742.882,06	R\$ 600.549.342,98	R\$ 538.409.311,66
CAIXA	R\$ 885.772.638,99	R\$ 911.387.782,17	R\$ 962.338.122,45
BANCO DO BRASIL	R\$ 892.067.238,64	R\$ 899.165.391,75	R\$ 936.067.835,44
ITAÚ	R\$ 178.288.619,67	R\$ 195.137.097,53	R\$ 210.698.782,98
SANTANDER	R\$ 249.709.431,43	R\$ 252.648.965,71	R\$ 253.769.238,96
TOTAL	R\$ 2.804.580.810,79	R\$ 2.858.888.580,14	R\$ 2.901.283.291,49

Quadro 2

Relatório de Investimentos abril de 2018

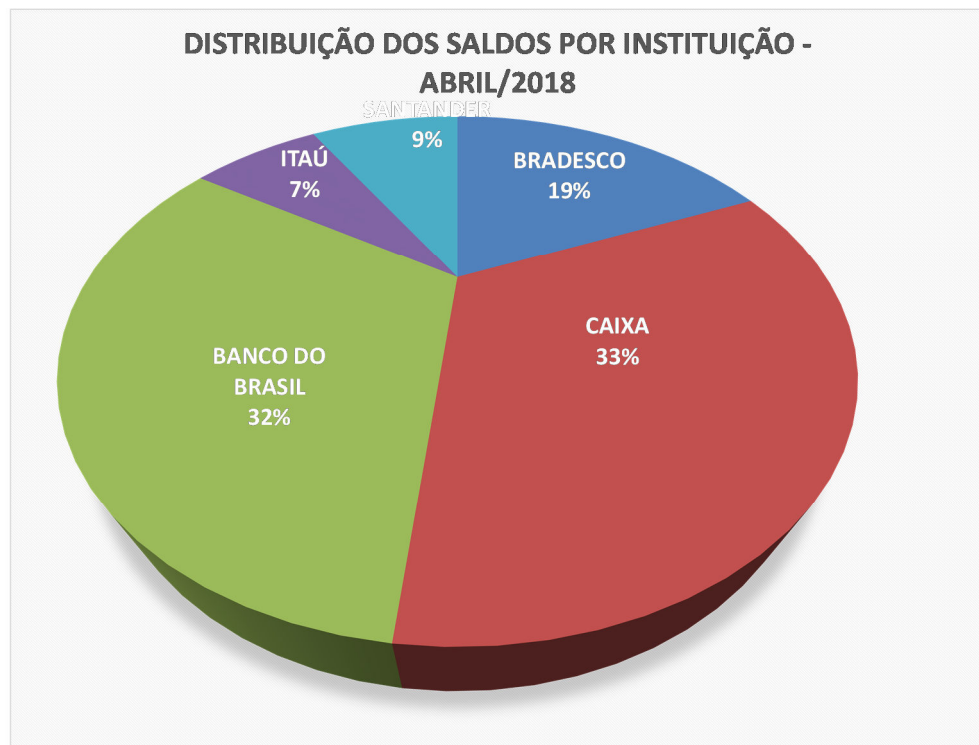


Gráfico 1

2.3 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA

FUNDO DE INVESTIMENTO	ÍNDICE DE REFERÊNCIA	SALDO APLICADO	% APLICADO
BRADESCO FI REFER DI PREMIUM BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA SANTANDER FIC FI INST. RF REF DI ITAÚ INST. REFERENCIADO DI FI	CDI	R\$ 643.632.041,85	22,18%
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	CDI ATIVO	R\$ 408.039.429,21	14,06%
CAIXA FI BRASIL IRF M1 TP RF BB PREVID RF IRF M1	IRF M 1	R\$ 829.375.246,61	28,59%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5 CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	IMA B 5	R\$ 651.257.531,62	22,45%
BB PREVID IDKA 2 TP RF	IDKA 2	R\$ 235.283.258,83	8,11%
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF BB PREVID TP VII BB PREVID TP IX	IPCA + 6%	R\$ 128.511.802,47	4,43%
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO	IBOVESPA ATIVO	R\$ 5.183.980,90	0,18%
TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO		R\$ 2.901.283.291,49	100%

Quadro 3

Relatório de Investimentos abril de 2018

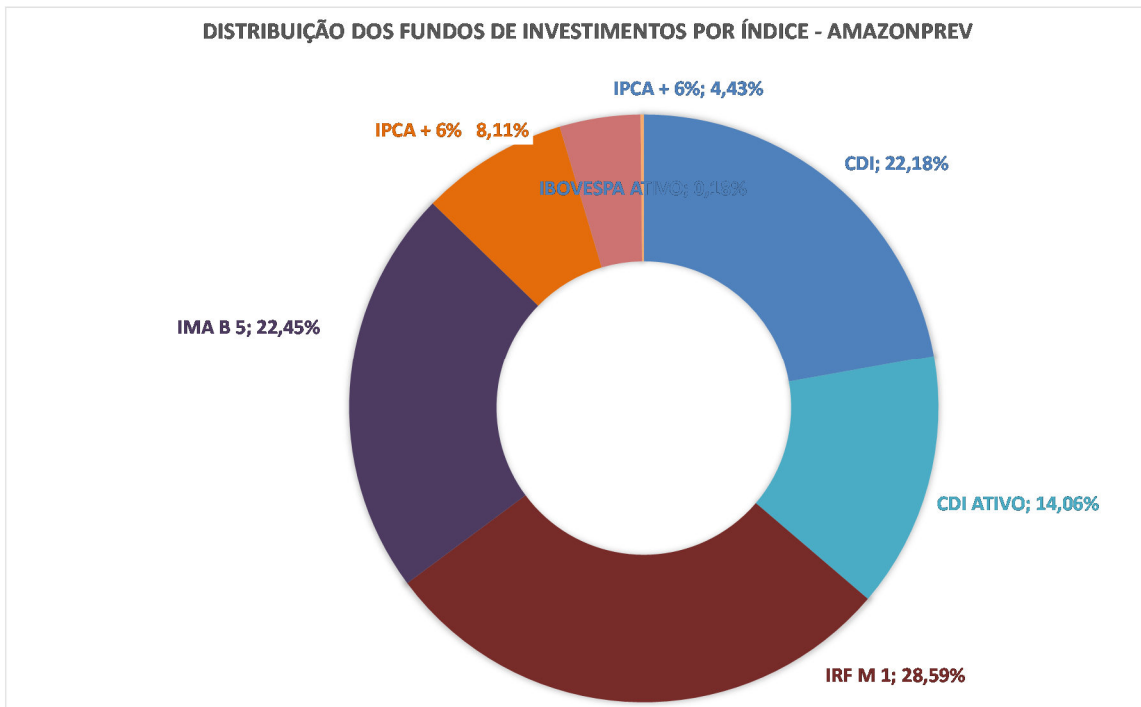


Gráfico 2

2.4 COMPARATIVO DOS ÍNDICES DE REFERÊNCIA

ÍNDICE	abr/18	ACUMULADO 2018	12 MESES
CDI	0,5200%	2,1200%	8,1200%
IMA-B 5	0,4215%	3,9669%	11,6480%
IMA-B	-0,1438%	4,7903%	10,9323%
IMA B 5+	-0,6290%	5,2695%	10,4470%
IRF M 1	0,5055%	2,3163%	8,9394%
IDKA 2	0,8238%	3,8600%	12,2972%
IBOVESPA	0,8800%	12,7100%	31,6700%

Quadro 4

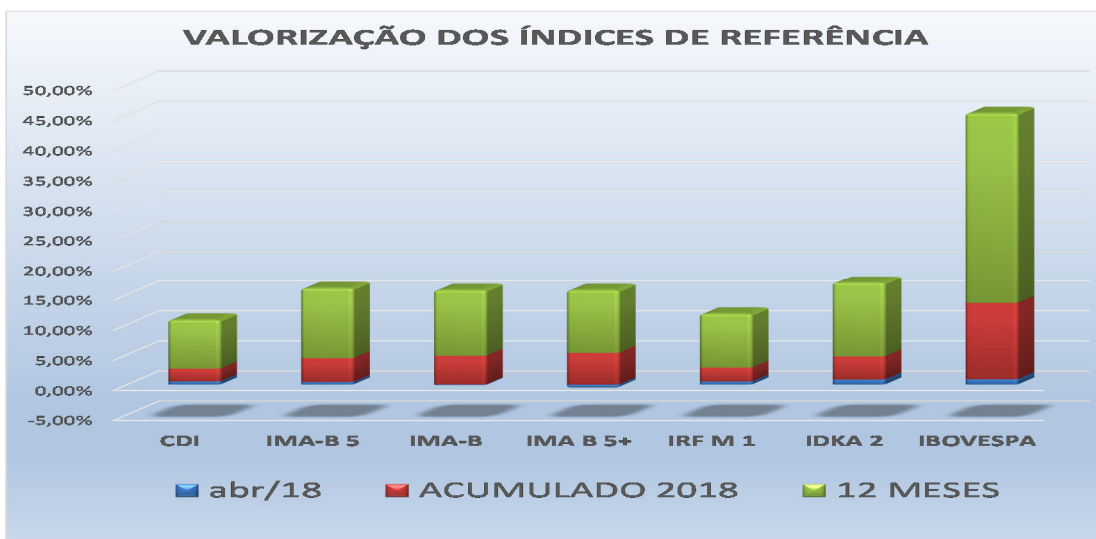


Gráfico 3.

Relatório de Investimentos abril de 2018

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/03/2018	30/04/2018	fev/18	mar/18	abr/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 145.460.795,87	R\$ 145.437.311,02	0,4295	2,1009	(0,0161)	2,5229%	7,0637%	15,9786%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 147.777.381,57	R\$ 147.311.330,75	0,1222	0,7366	(0,3154)	0,5416%	5,0808%	10,9878%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 150.032.304,56	R\$ 149.559.142,31	0,1222	0,7366	(0,3154)	0,5416%	4,9841%	10,8857%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 153.742.055,12	R\$ 152.709.615,42	0,1591	0,3131	(0,6715)	-0,2019%	5,4520%	11,1512%
TOTAL GERAL	R\$ 597.012.537,12	R\$ 595.017.399,50						

Quadro 5

2.6 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS – TPF

SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
TIPO DE ATIVO	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B
INTERMEDIÁRIO	BRDESCO	BRDESCO	BRDESCO	BRDESCO
PREÇO UNITÁRIO DE COMPRA	R\$ 2.314,742871	R\$ 2.288,539269	R\$ 2.235,637189	R\$ 2.254,343911
PREÇO UNITÁRIO ATUAL	R\$ 3.374,415569	R\$ 3.390,364344	R\$ 3.390,364344	R\$ 3.443,283324
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\$ 145.437.311,02	R\$ 147.311.330,75	R\$ 149.559.142,31	R\$ 152.709.615,42
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%
INSTITUIÇÃO CUSTODIANTE	SELIC	SELIC	SELIC	SELIC

Quadro 6

2.7 SALDOS CVS - FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	29/03/2018	30/04/2018
CVS - A	R\$ 1.833.412,34	R\$ 1.815.959,02
CVS - B	R\$ 11.864.269,90	R\$ 11.751.292,10
CVS - C	R\$ 237.833,96	R\$ 235.569,88
CVS - D	R\$ 1.301.075,16	R\$ 1.288.685,64
TOTAL	R\$ 15.236.591,36	R\$ 15.091.506,64

Quadro 7

Relatório de Investimentos abril de 2018

2.8 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/18	R\$ 45.365,76	R\$ 144.957,83	R\$ 190.323,59
fev/18	R\$ 44.946,11	R\$ 145.084,72	R\$ 190.030,83
mar/18	R\$ 44.526,14	R\$ 145.084,72	R\$ 189.610,86
abr/18	R\$ 44.106,16	R\$ 145.084,72	R\$ 189.190,88
TOTAL	R\$ 178.944,17	R\$ 580.211,99	R\$ 759.156,16

Quadro 8

2.9 CONTROLE DE RECEBIMENTO DE ALUGUEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2018			TOTAL
MÊS	UEA	SEAS	
jan/18	R\$ -	R\$ -	R\$ -
fev/18	R\$ -	R\$ 394.023,20	R\$ 394.023,20
mar/18	R\$ 53.422,83	R\$ 267.638,40	R\$ 321.061,23
abr/18	R\$ 106.845,66	R\$ -	R\$ 106.845,66
TOTAL	R\$ 160.268,49	R\$ 661.661,60	R\$ 821.930,09

Quadro 9

CONTROLE DE PAGAMENTO DE ALUGUEL - UEA - 2017

Referência: 6º Aditivo ao TC 017/11 (abril a set/16) e 7º Termo Aditivo (out/16 a março/17).

Valor Global: R\$ 560.939,60

COMPETÊNCIA	DATA PAGTO	DCTO	CRÉDITO	SALDO
abr/16	29/06/16	0004202	R\$ 53.422,83	R\$ 507.516,77
mai/16	29/06/16	0004203	R\$ 53.422,83	R\$ 454.093,94
jun/16	29/06/16	0004204	R\$ 53.422,83	R\$ 400.671,11
jul/16	29/06/16	0004205	R\$ 53.422,83	R\$ 347.248,28
ago/16	11/11/16	0004649	R\$ 53.422,83	R\$ 293.825,45
set/16	11/11/16	0004650	R\$ 53.422,83	R\$ 240.402,62
out/16	09/02/17	0000506	R\$ 40.067,12	R\$ 200.335,50
nov/16	09/02/17	0000507	R\$ 40.067,12	R\$ 160.268,38
dez/16	PENDENTE	PENDENTE		R\$ 160.268,38
jan/17	25/04/17	0001620	R\$ 40.067,12	R\$ 120.201,26
fev/17	05/06/17	0002638	R\$ 40.067,12	R\$ 80.134,14
mar/17	05/06/17	0002647	R\$ 40.067,12	R\$ 40.067,02

Quadro 10

Relatório de Investimentos abril de 2018

2.11 CONTROLE DE PAGAMENTO DE ALUGUEL DA UEA - 2017/2018

Processo Administrativo nº. 2017/00006856 - UEA

Valor Global: R\$ 641.073,96

Termo de Contrato nº 06/2017 - UEA

Valor Mensal R\$ 53422,83

COMPETÊNCIA	DATA PAGTO	DCTO	CRÉDITO	SALDO
abr/17	PENDENTE	PENDENTE	R\$ -	R\$ 641.073,96
mai/17	24/07/17	0004586	R\$ 53.422,83	R\$ 587.651,13
jun/17	11/08/17	0005156	R\$ 53.422,83	R\$ 534.228,30
jul/17	04/09/17	0005658	R\$ 53.422,83	R\$ 480.805,47
ago/17	04/09/17	0005658	R\$ 53.422,83	R\$ 427.382,64
set/17	19/12/17	0007271	R\$ 53.422,83	R\$ 373.959,81
out/17	19/12/17	0007270	R\$ 53.422,83	R\$ 320.536,98
nov/17	19/12/17	0007272	R\$ 53.422,83	R\$ 267.114,15
dez/17	19/12/17	0007310	R\$ 53.422,83	R\$ 213.691,32
jan/18	06/03/18	0011474	R\$ 53.422,83	R\$ 160.268,49
fev/18	25/04/18	0027026	R\$ 53.422,83	R\$ 106.845,66
mar/18	25/04/18	0027045	R\$ 53.422,83	R\$ 53.422,83

Quadro 11

Nota: Celebrado o Termo de Contrato 006/2017-UEA com valor mensal de 53.422,83 pelo prazo de 12 meses.

Nota 2: Recebidos no mês de abril/18 da UEA, pagtos. ref. aos aluguéis dos meses de fev e mar/18.

CONTROLE DE PAGAMENTO DE ALUGUEL - SEAS - 2016/2017

Processo Administrativo nº. 018.01777.14-SEAS

Valor Global R\$ 2.141.102,40

1º Aditivo ao Termo de Contrato nº.002/2015-SEAS

Valor Mensal R\$ 178.425,20

COMPETÊNCIA	DATA PAGTO	DCTO	CRÉDITO	SALDO
mar/16	05/07/17	0030147	R\$ 53.527,68	R\$ 2.087.574,72
abr/16	31/01/17	0004493	R\$ 178.425,60	R\$ 1.909.149,12
mai/16	14/03/17	0009993	R\$ 178.425,60	R\$ 1.730.723,52
jun/16	31/01/17	0004492	R\$ 178.425,60	R\$ 1.552.297,92

Quadro 12

Nota: Fonte: GERA.F. Atualizado após conciliação junto aos extratos bancários e Sistema AFI

Relatório de Investimentos abril de 2018

2.12 CONTROLE DE PAGAMENTO DE ALUGUEL - SEAS - 2017/2018

2º Aditivo ao Termo de Contrato n.º.002/2015-SEAS Valor Global R\$ 1.605.830,40
Valor Mensal R\$ 133.819,20

COMPETÊNCIA	DATA PAGTO	DCTO	CRÉDITO	SALDO
mar/17	07/07/17	0031093	R\$ 53.527,68	R\$ 1.552.302,72
abr/17	02/06/17	0023739	R\$ 133.819,20	R\$ 1.418.483,52
mai/17	05/07/17	0030146	R\$ 133.819,20	R\$ 1.284.664,32
mar/17	10/08/17	0036300	R\$ 92.186,56	R\$ 1.192.477,76
jun/17	01/09/17	0040592	R\$ 133.819,20	R\$ 1.058.658,56
jul/17	01/09/17	0040593	R\$ 133.819,20	R\$ 924.839,36
ago/17	14/12/17	0053846	R\$ 133.819,20	R\$ 791.020,16
set/17	18/12/17	0054764	R\$ 133.819,20	R\$ 657.200,96
out/17	23/02/18	0008369	R\$ 126.384,80	R\$ 530.816,16
nov/17	23/02/18	0008366	R\$ 133.819,20	R\$ 396.996,96
dez/17	23/02/18	0008366	R\$ 133.819,20	R\$ 263.177,76
jan/18	27/03/18	0017829	R\$ 133.819,20	R\$ 129.358,56
fev/18	27/03/18	0017381	R\$ 133.819,20	R\$ (4.460,64)
mar/18	10/05/18	0031155	R\$ 40.145,76	R\$ (44.606,40)

Quadro 13

Nota: Recebimento no dia 23/02/18 de três parcelas ref. aos meses de out, nov e dez/17.

Nota: Recebimento no dia 27/03/18 de duas parcelas ref. aos meses de jan e fev/18.

Nota: Recebimento no dia 10/05/18 de valor ref. a 9 (nove) dias do mês de março/18.

CONTROLE - TERMO DE CONFISSÃO DE DÍVIDA - SEAS

Valor Global: R\$ 4.566.330,41

COMPETÊNCIA	DATA PAGTO	DCTO	VALOR DEVIDO (a)	VALOR RECEBIDO (b)	DIFERENÇA (b-a)	SALDO DEVEDOR
Entrada	28/10/14	0066143	R\$ 180.797,23	R\$ 183.728,15	R\$ 2.930,92	R\$ 4.382.602,26
jan/15	01/04/15	0014147	R\$ 154.905,21	R\$ 151.974,29	-R\$ 2.930,92	R\$ 4.230.627,97
fev/15	01/04/15	0014148	R\$ 153.301,63	R\$ 153.301,63	R\$ -	R\$ 4.077.326,34
mar/15	17/04/15	0017173	R\$ 151.698,05	R\$ 151.698,05	R\$ -	R\$ 3.925.628,29
abr/15	28/05/15	0023911	R\$ 150.094,46	R\$ 150.094,46		R\$ 3.775.533,83
mai/15	16/06/15	0026742	R\$ 148.490,88	R\$ 148.490,88		R\$ 3.627.042,95
jun/15	10/07/15	0030543	R\$ 146.887,30	R\$ 146.887,30		R\$ 3.480.155,65
jul/15	10/08/15	0035833	R\$ 145.283,71	R\$ 145.283,71		R\$ 3.334.871,94
ago/15	10/09/15	0041482	R\$ 143.680,13	R\$ 143.680,13		R\$ 3.191.191,81
set/15	24/11/15	0054929	R\$ 142.076,55	R\$ 142.076,55		R\$ 3.049.115,26
out/15	24/11/15	0054930	R\$ 140.472,27	R\$ 140.472,27		R\$ 2.908.642,99
nov/15	21/01/16	0000909	R\$ 138.869,38	R\$ 138.869,38		R\$ 2.769.773,61
dez/15	21/01/16	0000911	R\$ 137.265,80	R\$ 137.265,80		R\$ 2.632.507,81
jan/16	30/05/16	0024970	R\$ 135.662,22	R\$ 135.662,22		R\$ 2.496.845,59
fev/16	30/05/16	0024971	R\$ 134.058,63	R\$ 134.058,63		R\$ 2.362.786,96
mar/16	30/05/16	0024976	R\$ 132.455,05	R\$ 132.455,05		R\$ 2.230.331,91
abr/16	30/05/16	0024973	R\$ 130.851,47	R\$ 130.851,47		R\$ 2.099.480,44
mai/16	30/05/16	0024973	R\$ 129.247,89	R\$ 129.247,89		R\$ 1.970.232,55
jun/16	29/09/16	0041630	R\$ 127.644,30	R\$ 127.644,30		R\$ 1.842.588,25

Relatório de Investimentos abril de 2018

Quadro 14

IMÓVEIS DO COMPLEXO IPIXUNA E DUQUE DE CAXIAS. Encaminhado memorando nº 180/2016 à DIRAF dando conhecimento sobre as licitações dos imóveis declaradas desertas. Encaminhado memorando nº 345/2016 com histórico da locação dos imóveis. Deliberação da Diretoria, do dia 31/08/2016, que a GEJUR analise a possibilidade de contratação de corretor de imóveis, através de procedimento licitatório, para locação dos imóveis. Em resposta através de parecer no processo 2014.A.04879, a GEJUR opina pela possibilidade de contratação de corretor de imóveis, com a ressalva que o percentual referente pagamento dos honorários seja pago diretamente pelo locatário. Em elaboração de Projeto Básico para encaminhar para Licitação. Em abril, o corretor de imóvel, mandou as propostas com os ajustes, em elaboração processo licitatório. Em razão da irregularidade fiscal da empresa Corretora de imóveis, será realizada nova pesquisa de mercado para proposta de serviços. Aguardando proposta de empresa Corretora de Imóveis. Em elaboração pela COMAP de projeto básico. Recebido documentação e certidões de regularidade fiscal da empresa corretora de imóveis para compor o processo. Solicitado ajustes de proposta e regularização de certidões fiscais. Projeto básico em ajustes pela GERAF e COMAP em razão da necessidade de outras propostas. Aguardando novas propostas para prestação dos serviços. Não recebido propostas para prestação dos serviços neste mês. Dificuldades para recebimento de propostas. Fonte: GERAF/COMAP.

IMÓVEL NO MUNICÍPIO DE TEFÉ: Foi elaborado o processo administrativo nº 2014.A.04022 que deverá ser encaminhado à Comissão Geral de Licitação para os procedimentos licitatórios e posteriormente a alienação do imóvel, localizado em Tefé. O processo estava na Gerência Jurídica para reanálise do processo de abertura de procedimento licitatório. O processo foi encaminhado pela GEJUR em outubro a PGE para consulta sobre o tema, mas até o mês de novembro de 2015 não retornou para Amazonprev. O processo retornou da PGE em 11/12/2015 com a recomendação da necessidade de autorização legislativa prévia para alienação do imóvel, podendo ser uma autorização de forma genérica na LC 30/2001 e que já consta no projeto de alteração da LC 30/2001 encaminhada a Casa Civil. No mês de novembro houve alteração da LC 30/2001 com inclusão da possibilidade da alienação dos bens imóveis. Em elaboração processo para deliberação da Diretoria para alienação do imóvel. Processo em fase de ajustes pela COMAP para dar prosseguimento aos procedimentos de

Relatório de Investimentos abril de 2018

alienação. Encaminhado processo 2014.A.04022 à GEJUR para emissão de parecer. Fonte: GERA/COMAP.

IMÓVEIS EM LITÍGIO

Imóvel	Localização	Valor do Imóvel	Situação
Travessa Rio Branco s/n, Parintins - AM	Parintins	R\$ 137.100,00	Solicitado por parte da Amazonprev a ampliação de penhora de bens para pagamento da Amazonprev, deferida pelo Juiz
Av. Governador Gilberto Mestrinho - Fonte Boa - AM	Fonte Boa	R\$ 352.000,00	A Amazonprev elaborou a réplica da contestação de posse, mas até o momento não há notícias de novo trâmite processual.

Quadro 15

Nota: O Município de Fonte Boa continua em correição desde novembro de 2014. O Juiz Rafael Rodrigo da Silva Raposo, lotado na Vara de Fonte Boa, assumiu o cargo há quase um ano, porém ainda não analisou os autos da Amazonprev. **Fonte:** GEJUR.

2.14 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO	
	29/03/2018	30/04/2018
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 2.858.888.580,14	R\$ 2.901.283.291,49
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 597.012.537,12	R\$ 595.017.399,50
TÍTULOS CVS	R\$ 15.236.591,36	R\$ 15.091.506,64
IMÓVEIS	R\$ 64.528.000,00	R\$ 64.528.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 3.535.665.708,62	R\$ 3.575.920.197,63

Quadro 16

Relatório de Investimentos abril de 2018

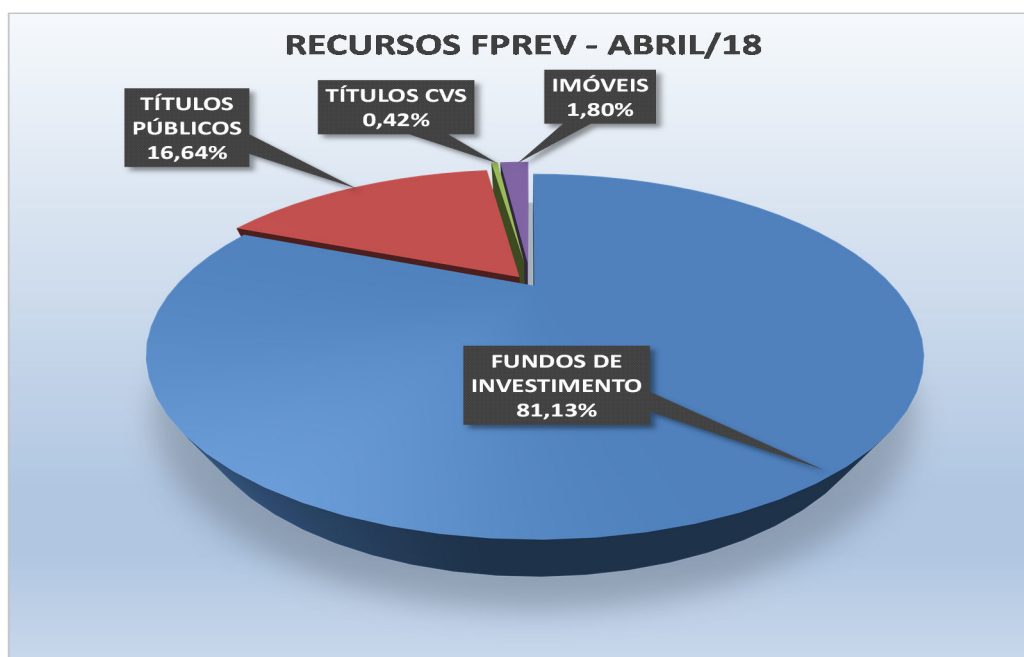


Gráfico 4

2.15 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS – FPREV EXECUTIVO

Mês	Recursos FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
mar/17	R\$ 2.901.303.752,77	1,90%	7,42%	31,38%
abr/17	R\$ 2.930.172.240,47	1,00%	8,48%	28,32%
mai/17	R\$ 2.952.298.019,40	0,76%	9,30%	27,23%
jun/17	R\$ 2.993.728.697,93	1,40%	10,84%	25,95%
jul/17	R\$ 3.091.042.425,42	3,25%	14,44%	26,78%
ago/17	R\$ 3.150.753.915,37	1,93%	16,65%	26,54%
set/17	R\$ 3.215.911.304,31	2,07%	19,06%	26,45%
out/17	R\$ 3.252.585.663,77	1,14%	18,05%	25,80%
nov/17	R\$ 3.290.522.494,61	1,17%	19,43%	25,94%
dez/17	R\$ 3.349.596.826,89	1,80%	24,01%	24,01%
jan/18	R\$ 3.432.495.345,53	2,47%	2,47%	24,58%
fev/18	R\$ 3.476.496.589,48	1,28%	3,79%	22,11%
mar/18	R\$ 3.535.665.708,62	1,70%	5,55%	21,86%
abr/18	R\$ 3.575.920.197,63	1,14%	6,76%	22,04%

Quadro 17

2.16 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO

PERÍODO	TAXA
abril/17	0,14%
mar/18	0,09%
abril/18	0,22%
Acumulado no ano de 2018	0,92%
Acumulado nos últimos 12 meses	2,76%
Meta Atuarial no mês	0,7078%

Quadro 1

Relatório de Investimentos abril de 2018

2.17 RENTABILIDADE FPREV EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	ABRIL/18	ACUMULADO 2018	ÚLTIMOS 12 MESES	ACUMULADO 2005 - 2018
RENTABILIDADE DO FPREV	0,3532%	3,0000%	9,7401%	397,0284%
META ATUARIAL	0,7078%	2,9000%	8,9280%	349,7193%
RESULTADO ATUARIAL	-0,3521%	0,0972%	0,7455%	10,5197%

Quadro 19

Nota: Rentabilidade do FPREV validada pelo atuário.

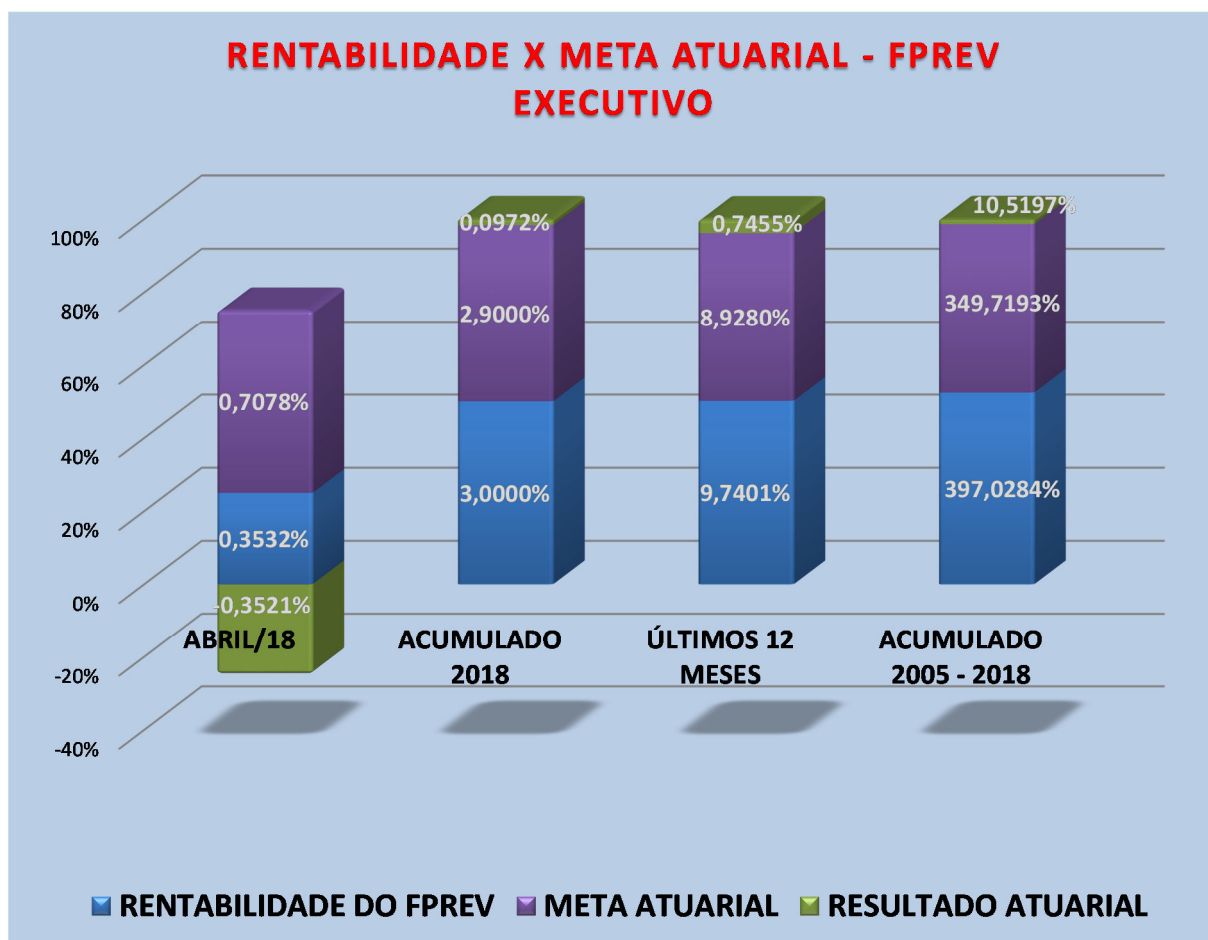


Gráfico 5.

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO- FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	29/03/2018	30/04/2018	fev/18	mar/18	abr/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO FI REF DI FEDERAL EXTRA	R\$ 6.031.864,76	R\$ -	0,0971	0,5176	0,0957	0,7115%	0,7115%	NC	
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ -	R\$ 3.078.732,23	-	-	0,4357	0,4357%	0,4357%	NC	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ -	R\$ 3.134.643,27	-	-	0,3299	0,3299%	0,3299%	NC	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -							
TOTAL	R\$ 6.031.864,76	R\$ 6.213.375,50							

Quadro 20

Relatório de Investimentos abril de 2018

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/03/2018	30/04/2018	fev/18	mar/18	abr/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.016.846,66	R\$ 2.010.486,05	0,1222	0,7366	(0,3154)	0,5416%	4,9841%	10,8857%
TOTAL GERAL	R\$ 2.016.846,66	R\$ 2.010.486,05						

Quadro 21

3.3 Composição dos Recursos – ALE/FPREV

FUNDO DE INVESTIMENTO	fev/18	mar/18	abr/18
SALDO ANTERIOR	7.784.283,78	7.911.489,25	8.048.711,42
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	89.801,21	91.709,89	94.575,32
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	37.404,26	45.512,28	80.574,81
SALDO FINAL	7.911.489,25	8.048.711,42	8.223.861,55

Quadro 22

3.4 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO	
	29/03/2018	30/04/2018
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 6.031.864,76	R\$ 6.213.375,50
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.016.846,66	R\$ 2.010.486,05
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 8.048.711,42	R\$ 8.223.861,55

Quadro 23

3.5 Evolução dos Recursos – ALE/FPREV

Mês	Recursos ALE FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
mar/17	R\$ 6.263.169,08	2,48%	10,65%	47,00%
abr/17	R\$ 6.360.541,05	1,55%	12,37%	42,62%
mai/17	R\$ 6.465.577,61	1,65%	14,23%	41,46%
jun/17	R\$ 6.602.039,70	2,11%	16,64%	39,50%
jul/17	R\$ 6.814.460,07	3,22%	20,39%	39,10%
ago/17	R\$ 6.976.419,44	2,38%	23,25%	37,97%
set/17	R\$ 7.138.676,97	2,33%	26,12%	37,40%
out/17	R\$ 7.245.680,53	1,50%	33,51%	35,88%
nov/17	R\$ 7.349.135,69	1,43%	35,41%	35,41%
dez/17	R\$ 7.574.592,78	3,07%	33,82%	33,82%
jan/18	R\$ 7.784.283,78	2,77%	32,44%	27,36%
fev/18	R\$ 7.911.489,25	1,63%	29,44%	26,32%
mar/18	R\$ 8.048.711,42	1,73%	6,26%	26,54%
abr/18	R\$ 8.223.861,55	2,18%	8,57%	27,19%

Quadro 24

Relatório de Investimentos abril de 2018

3.6 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

DESCRIÇÃO	ABRIL/18	ACUMULADO 2018	ÚLTIMOS 12 MESES	ACUMULADO 2012 - 2018
RENTABILIDADE DO FPREV	1,0011%	3,6791%	10,0930%	117,219358%
META ATUARIAL	0,7078%	2,9024%	8,9280%	107,119325%
RESULTADO ATUARIAL	0,2912%	0,7548%	1,0695%	4,876432%

Quadro 25

Nota: Obs: Rentabilidade calculada e validada pelo atuário – ALE/FPREV

4. CONSOLIDADO - FPREV ALE E EXECUTIVO

4.1 Evolução dos Recursos Consolidados – ALE FPREV e EXECUTIVO

ANO	ALE FPREV	EXEC. FPREV	TOTAL FPREV
2004	R\$ -	R\$ 15.862.618,50	R\$ 15.862.618,50
2005	R\$ -	R\$ 57.510.136,49	R\$ 57.510.136,49
2006	R\$ -	R\$ 83.649.681,60	R\$ 83.649.681,60
2007	R\$ -	R\$ 75.698.485,78	R\$ 75.698.485,78
2008	R\$ -	R\$ 179.805.240,72	R\$ 179.805.240,72
2009	R\$ -	R\$ 341.872.841,56	R\$ 341.872.841,56
2010	R\$ -	R\$ 489.868.867,80	R\$ 489.868.867,80
2011	R\$ -	R\$ 657.928.672,97	R\$ 657.928.672,97
2012	R\$ 436.901,72	R\$ 936.612.579,50	R\$ 937.049.481,22
2013	R\$ 1.239.708,12	R\$ 1.166.915.511,62	R\$ 1.168.155.219,74
2014	R\$ 2.509.280,78	R\$ 1.571.464.403,45	R\$ 1.573.973.684,23
2015	R\$ 3.643.310,21	R\$ 2.012.490.466,39	R\$ 2.016.133.776,60
2016	R\$ 5.660.283,00	R\$ 2.700.997.719,11	R\$ 2.706.658.002,11
2017	R\$ 7.574.592,78	R\$ 3.349.596.826,89	R\$ 3.357.171.419,67
2018	R\$ 8.223.861,55	R\$ 3.575.920.197,63	R\$ 3.584.144.059,18

Quadro 26

4.2 Rentabilidade Consolidada – ALE FPREV e EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	ABRIL/18	ACUMULADO 2018	ÚLTIMOS 12 MESES
RENTABILIDADE CONSOLIDADA	0,3547%	2,9997%	9,7439%
META ATUARIAL	0,7078%	2,9024%	8,9280%
RESULTADO ATUARIAL	-0,3506%	0,0946%	0,7490%

Quadro 27

Relatório de Investimentos abril de 2018

5. RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

5.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Investimentos – FFIN Executivo

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/03/2018	30/04/2018	fev/18	mar/18	abr/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 638.453,62	R\$ 101.201,73	0,4400	0,5075	0,4933	1,4477%	2,0303%	8,1200%
BRDESCO FI RF IRF MI - COMPREV	R\$ 7.427.017,40	R\$ 7.458.391,91	0,5186	0,6451	0,4909	1,6637%	2,2497%	8,7600%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 1,00						
TOTAL	R\$ 8.065.472,02	R\$ 7.559.594,64						

Quadro 28

5.2 Disponibilidade Financeira e Cobertura do Déficit – FFIN ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	29/03/2018	30/04/2018
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 18.587,73
TOTAL	R\$ -	R\$ -

Quadro 29

5.3 Composição do Recursos – FFIN Executivo

FUNDO DE INVESTIMENTO	fev/18	mar/18	abr/18
SALDO ANTERIOR	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	R\$ 794.524,29	R\$ 800.290,49	R\$ 818.890,52
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ 1.278.753,83	R\$ 1.271.904,84	R\$ 1.290.098,70
VARIAÇÃO FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -	R\$ -
SAIDAS FINANCEIRAS	(2.073.278,12)	(2.072.195,33)	(2.090.401,49)
SALDO FINAL	-	-	18.587,73

Quadro 30

5.4 Disponibilidade Financeira – FFIN EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	29/03/2018	30/04/2018
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 146.102,21	R\$ 145.543,81
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ 14.294,43	R\$ 14.284,91
REPASSES PATRONAIS	R\$ -	R\$ -

Quadro 31

Nota: Salários Não Reclamados referem-se aos proventos de aposentadoria ou pensão que são devolvidos pelo Banco devido a inconsistências bancárias na folha de pagamento.

Nota: Saldo de Cobertura de Déficit referente a IRRF de pensionistas e Repasse de Patronais regularizados em abril/2018.

Relatório de Investimentos abril de 2018

6. TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

6.1 SALDOS E PERFORMANCE DOS RECURSOS – TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/03/2018	30/04/2018	fev/18	mar/18	abr/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.518.689,00	R\$ 1.198.455,27	0,4400	0,5075	0,4933	1,4477%	2,0152%	8,1200%
CAIXA FI BRASIL IRF M1 TP RF	R\$ 31.463.136,85	R\$ 32.618.448,09	0,5338	0,6351	0,4879	1,6659%	2,2494%	8,7555%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 1,00						
TOTAL	R\$ 32.981.826,85	R\$ 33.816.904,36						

Quadro 32

7. RECURSOS DOS OUTROS PODERES – TJA E TCE

7.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	29/03/2018	30/04/2018	fev/18	mar/18	abr/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FI REF. DI FEDERAL EXTRA	R\$ 91.693.943,61	R\$ 91.997.605,23	0,0724	0,5150	0,5005	1,0912%	1,0912%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF M1 TP RF - TJA	R\$ 126.329.838,14	R\$ 126.946.225,27	0,5338	0,6351	0,4879	1,6659%	2,2453%	8,7555%
BB PREV. RF IRF M1 - TJA	R\$ 121.508.333,81	R\$ 122.091.528,42	0,5246	0,6298	0,4799	1,6432%	2,2380%	8,7057%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1.751,63	R\$ 3.017.241,15						
TOTAL	R\$ 339.533.867,19	R\$ 344.052.600,07						

Quadro 33

7.2 Composição dos Saldos - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	fev/18	mar/18	abr/18
SALDO ANTERIOR	330.161.670,95	334.680.639,61	339.533.867,19
REPASSES FINANCEIROS	2.892.548,16	3.164.081,68	3.018.731,72
VARIAÇÃO FINANCEIRA	1.762.831,26	1.856.582,55	1.658.771,93
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(136.410,76)	(167.436,65)	(158.770,77)
SALDO FINAL	R\$ 334.680.639,61	R\$ 339.533.867,19	R\$ 344.052.600,07

Quadro 34

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

7.3 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	29/03/2018	30/04/2018	fev/18	mar/18	abr/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FI REF. DI FEDERAL EXTRA	R\$ 40.404.039,18	R\$ 40.606.375,64	0,0724	0,5150	0,5005	1,0912%	1,0912%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF M1 TP RF - TCE	R\$ 51.800.096,87	R\$ 52.381.717,73	0,5338	0,6351	0,4879	1,6659%	2,2453%	8,7555%
BB PREV. RF IRF M1 - TCE	R\$ 50.254.380,76	R\$ 50.495.583,01	0,5246	0,6298	0,4799	1,6432%	2,2380%	8,7057%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 328.822,82						
TOTAL	R\$ 142.458.516,81	R\$ 143.812.499,20						

Quadro 35

Relatório de Investimentos abril de 2018

7.4 Composição dos Saldos - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	fev/18	mar/18	abr/18
SALDO ANTERIOR	138.590.015,40	140.922.470,70	142.458.516,81
REPASSES FINANCEIROS	1.699.170,66	829.616,37	838.061,09
VARIAÇÃO FINANCEIRA	742.911,02	848.030,07	674.651,03
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(109.626,38)	(141.600,33)	(158.729,73)
SALDO FINAL	R\$ 140.922.470,70	R\$ 142.458.516,81	R\$ 143.812.499,20

Quadro 36

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

8. ENQUADRAMENTO

8.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% DA CARTEIRA	LIMITADA RESOLUÇÃO	Res. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
TÍTULOS DO TN	R\$ 597.027.885,55	14,76%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 833.507.876,66	53,36%	100,00%	art. 7º, inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 31.338.335,41			
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ 8.525.475,97			
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 235.283.258,83			
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 153.019.356,67			
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 380.400.872,47			
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 427.816.907,11			
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 42.873.033,13			
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 45.774.957,96			
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.299.657,00	31,38%	40%	art. 7º, inciso IV, "a"
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 358.564.757,71			
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 242.027.266,98			
BRADESCO FI RF IRFM 1	R\$ 7.458.391,91			
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 73.500.000,07			
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 135.804.667,24			
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 203.980.700,77			
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	R\$ 71.388.704,47			
SANTANDER FIC INST. RF REF DI	R\$ 100.749.882,29			
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI	R\$ 74.894.115,74			
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.183.980,90	0,13%	10%	art. 8º, inciso III
TÍTULOS CVS	R\$ 15.091.506,64	0,37%	-	TÍTULO NÃO REGISTRADO NO SELIC
TOTAL	R\$ 4.045.511.591,48	100,00%		

Quadro 37

Relatório de Investimentos abril de 2018

8.2 Enquadramento II – Limites Gerais – art. 13º - Res. CMN 3922/10 atualizada pela Res. Nº 4.604/17.

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	TOTAL DOS RECURSOS DO RPPS	% CARTEIRA	Res. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.299.657,00	R\$ 4.049.036.073,90	0,03%	20%
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 358.564.757,71		8,86%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 242.027.266,98		5,98%	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 135.804.667,24		3,35%	
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI	R\$ 74.894.115,74		1,85%	
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	R\$ 71.388.704,47		1,76%	
SANTANDER FIC INST. RF REF DI	R\$ 100.749.882,29		2,49%	
BRADESCO FI RF IRFM I	R\$ 7.458.391,91		0,18%	

Quadro 38

Nota 1: Art. 13. As aplicações em cotas de um mesmo fundo de investimento a que se referem o art. 7º, incisos III e IV não podem exceder a 20% (vinte por cento) das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social. (Quadro 38)

Nota 2: O Total dos Recursos considera os valores aplicados em Fundos de Investimentos e Títulos Públicos acrescido do valor de Disponibilidade Financeira. Não considera o valor de Imóveis. (quadro 38)

8.3 Enquadramento III – Limites Gerais – art. 13º - Res. CMN 3922/10 atualizada pela Res. Nº 4.604/17.

FUNDOS DE INVESTIMENTO	TOTAL APLICADO	CNPJ	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Res. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM I FIC FI	R\$ 833.507.876,66	11.328.882/0001-35	11.510.460.841,27	7,24%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 31.338.335,41	19.523.305/0001-06	1.166.021.109,04	2,69%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ 8.525.475,97	20.734.937/0001-06	354.296.270,88	2,41%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 235.283.258,83	13.322.205/0001-35	6.381.522.306,58	3,69%	
SANTANDER FIC INST. REF DI	R\$ 100.749.882,29	02.224.354/0001-45	5.020.928.153,43	2,01%	
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 153.019.356,67	13.455.117/0001-01	1.304.781.541,54	11,73%	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 135.804.667,24	25.306.703/0001-73	1.370.015.948,40	9,91%	
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI	R\$ 74.894.115,74	00.832.435/0001-00	1.324.558.707,41	5,65%	
CAIXA FI BRASIL IRF M I TP RF	R\$ 380.400.872,47	10.740.670/0001-06	15.543.447.913,07	2,45%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 427.816.907,11	11.060.913/0001-10	7.947.962.119,28	5,38%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 203.980.700,77	23.215.097/0001-55	1.660.467.972,10	12,28%	
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	R\$ 71.388.704,47	18.598.256/0001-08	1.327.221.623,08	5,38%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 42.873.033,13	22.791.028/0001-27	251.021.326,08	17,08%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 45.774.957,96	22.791.074/0001-26	186.806.672,87	24,50%	
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.183.980,90	14.386.860/0001-10	258.749.539,32	2,00%	
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 358.564.757,71	03.256.793/0001-00	6.772.399.393,89	5,29%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 73.500.000,07	20.216.216/0001/04	563.080.501,41	13,05%	
BRADESCO FI RF IRFM I	R\$ 7.458.391,91	11.492.176/0001-24	682.538.498,84	1,09%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.299.657,00	08.246.263/0001-97	285.612.203,97	0,46%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 242.027.266,98	03.399.411/0001-90	8.876.380.016,02	2,73%	

Quadro 39

Relatório de Investimentos abril de 2018

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

Nota 3: 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.

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA MAR/18) EM R\$ BI	TOTAL RECURSOS - AMAZONPREV	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Res. nº. 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
BB DTVM S.A	R\$ 892.918,69	R\$ 1.108.654.946,87	0,1242%	5%
BRADESCO	R\$ 601.398,29	R\$ 682.850.073,67	0,1135%	
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 618.921,66	R\$ 210.698.782,98	0,0340%	
CAIXA	R\$ 292.488,20	R\$ 1.177.419.156,81	0,4026%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	R\$ 260.311,60	R\$ 253.769.238,96	0,0975%	

Quadro 40

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, para o Gestores de Recursos de Terceiros.

Relatório de Investimentos abril de 2018

9. TOTAL DOS RECURSOS - AMAZONPREV

FPREV PODER EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 2.901.283.291,49
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 595.017.399,50
CVS	R\$ 15.091.506,64
IMÓVEIS	R\$ 64.528.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
TOTAL	R\$ 3.575.920.197,63

ASSEMBLEIA LEGISLATIVA - ALE FPREV E ALE FFIN

DESCRIÇÃO	SALDO
ALE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 6.213.375,50
ALE FPREV TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.010.486,05
ALE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
ALE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ -
ALE FFIN DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 18.587,73
TOTAL	R\$ 8.242.449,28

TAXA DE ADM. FFIN EXECUTIVO, COMPREV, SAL. NÃO RECL. E DISP. FINANCEIRA

DESCRIÇÃO	SALDO
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	R\$ 33.816.903,36
FUNDO FINANCEIRO - EXECUTIVO	R\$ 101.201,73
FUNDO FINANCEIRO - COMPREV	R\$ 7.458.391,91
DISP. FINANCEIRA - TAXA DE ADM.	R\$ 1,00
DISP. FINANCEIRA - FFIN	R\$ 1,00
DISP. FINANCEIRA - REP. COBERT. DEFICIT	R\$ 14.284,91
DISP. FINANCEIRA - SAL. NÃO RECLAMADOS	R\$ 145.543,81
DISP. REPASSES PATRONAIS	R\$ -
TOTAL	R\$ 41.536.327,72

OUTROS PODERES

ORGÃOS	SALDO
TJ/AM	R\$ 341.035.358,92
TCE/AM	R\$ 143.483.676,38
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA/TCE	R\$ 3.346.063,97
TOTAL	R\$ 487.865.099,27
TOTAL GERAL	4.113.564.073,90

Quadro 41

Relatório de Investimentos abril de 2018

9.1 CONSOLIDADO DOS RECURSOS - AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	FPREV PODER EXECUTIVO	FPREV - ALE	TOTAL - FPREV
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 2.901.283.291,49	R\$ 6.213.375,50	R\$ 2.907.496.666,99
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 595.017.399,50	R\$ 2.010.486,05	R\$ 597.027.885,55
CVS	R\$ 15.091.506,64	R\$ -	R\$ 15.091.506,64
IMÓVEIS	R\$ 64.528.000,00	R\$ -	R\$ 64.528.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 3.575.920.197,63	R\$ 8.223.861,55	R\$ 3.584.144.059,18

DESCRIÇÃO	FFIN - PODER EXECUTIVO	FFIN - ALE	TOTAL FFIN
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 101.201,73	R\$ -	R\$ 101.201,73
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 18.587,73	R\$ 18.588,73
TOTAL	R\$ 101.202,73	R\$ 18.587,73	R\$ 119.790,46

DESCRIÇÃO	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	SALARIOS NÃO RECLAMADOS	TOTAL OUTROS RECURSOS
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 33.816.903,36	R\$ -	R\$ 33.816.903,36
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 145.543,81	R\$ 145.544,81
TOTAL	R\$ 33.816.904,36	R\$ 145.543,81	R\$ 33.962.448,17

DESCRIÇÃO	COMPREV	DISP. COBERTURA DEFICIT E REPASSE PATRONAIS	TOTAL OUTROS RECURSOS
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 7.458.391,91	R\$ -	R\$ 7.458.391,91
DISP. FINANCEIRA - REP. COBERT. DEFICIT	R\$ -	R\$ 14.284,91	R\$ 14.284,91
DISP. REPASSES PATRONAIS	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 7.458.391,91	R\$ 14.284,91	R\$ 7.472.676,82

DESCRIÇÃO	RECURSOS TJ/AM	RECURSOS TCE/AM	RECURSOS TCE/AM
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 341.035.358,92	R\$ 143.483.676,38	R\$ 484.519.035,30
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 3.346.063,97	R\$ -	R\$ 3.346.063,97
TOTAL	R\$ 344.381.422,89	R\$ 143.483.676,38	R\$ 487.865.099,27

TOTAL DOS RECURSOS - AMAZONPREV	R\$ 4.113.564.073,90
--	-----------------------------

Quadro 42

Relatório de Investimentos abril de 2018



Gráfico 6.

Sem mais a informar, segue para Superior Consideração.

Respeitosamente,

Alan Nascimento
Coordenador

Bruno Costa Novo
Secretário

Leonardo Cavalcanti
Membro

Renício Ferreira
Membro