

## **Relatório de Investimentos março de 2018**

---

Destino: DIRAF / PRESI

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

Data: 16/04/2018

### **RELATÓRIO Nº. 010 / 2018 – COMIV**

Senhores Diretores,

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

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 03 a 04);
- 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 05 a 15);
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário FPREV/ALEAM (páginas 15 a 16);
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado – FPREV Executivo e ALE (página 17);
- 5) Recursos do Fundo Financeiro Executivo – FFIN - (página 17 a 18);
- 6) Recursos da Taxa de Administração - (página 18);
- 7) Recursos dos Outros Poderes: Saldos e Composição por órgão – TCE e TJA (página 19);
- 8) Enquadramento das Aplicações Financeiras, com base na legislação vigente (páginas 20 a 22);
- 9) Consolidado e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 23 a 25).

## **Relatório de Investimentos março de 2018**

---

### **1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS**

#### **Brasil: crescimento consistente, ainda que um pouco mais gradual**

O desempenho mais moderado da atividade no começo do ano, como apontado no relatório do mês anterior, tem se materializado. Com isso, foi atualizada a projeção de crescimento para deixar o cenário um pouco mais simétrico. Por ora, a perda de dinamismo do início do ano muito mais ao fim do efeito do FGTS na economia do que a uma mudança de perspectiva. Os juros estão em queda, a inflação segue baixa, o emprego e o crédito vêm se recuperando, os estoques estão baixos e não há restrições externas na economia. Os dados correntes têm apontado para uma recuperação disseminada, mas ainda gradual: a indústria segue em trajetória ascendente, mas comércio, serviços e agora o emprego têm mostrado um menor dinamismo. Diante das últimas informações, nossa projeção para o PIB do primeiro trimestre passou de uma expansão de 0,5% para outra de 0,3%. Com a retomada gradual da atividade e apesar do aumento da volatilidade do câmbio, mantido o cenário de IPCA em 3,5% para este ano. Dessa forma esse cenário base está alinhado com o plano de voo proposto pelo Banco Central. A inflação segue apresentando dinâmica benigna e a velocidade de descompressão continua surpreendendo. Esse cenário base está alinhado com o plano de voo proposto pelo Banco Central, que deve levar a taxa Selic para 6,25% em maio e seguir nesse patamar até o final do ano. Por outro lado, se a velocidade de recuperação esperada para a atividade econômica não se concretizar ou observada uma nova rodada de surpresa baixista relevante na inflação corrente, novos cortes de juros podem ser discutidos desde que amparados em resposta favorável das expectativas de inflação e de suporte vindo do modelo do Banco Central, com crescente ênfase no cenário de preços para 2019.

#### **Mundo: guerra comercial e questões regulatórias colocam novos desafios ao cenário global construtivo e devem ser observadas com atenção**

É destacado, nos últimos trimestres, que a economia global está passando por seu melhor momento desde a crise de 2008. Entretanto, alguns novos riscos emergiram nas últimas semanas, o que requer uma avaliação mais atenta sobre seus possíveis impactos daqui em diante. Decisões recentes vindas dos Estados Unidos causaram aumento de tensão no comércio

## **Relatório de Investimentos março de 2018**

---

internacional, tais como: as altas de tarifas de importação sobre alumínio e aço e, mais importante, o anúncio de medidas contra importações chinesas que podem afetar de US\$ 50 a US\$ 100 bilhões de bens e serviços importados. Em paralelo, ameaças de aumento de regulação e tributos afetaram os preços das ações do setor de tecnologia norteamericano, com possível efeito secundário negativo sobre a economia adiante. Apesar de uma leve desaceleração no ritmo de crescimento do primeiro trimestre em alguns países, a velocidade de expansão da economia global mantém-se sólida. Os atuais níveis dos índices PMIs globais, que refletem o desempenho da indústria de uma amostra considerável de países, por exemplo, são compatíveis com expansão de 4,5% do PIB mundial, com sinais positivos na Europa, Japão e China e ausência de restrições externas na maioria dos emergentes. Sendo assim, não há elementos de preocupação endógenos para economia global neste momento e os focos de risco estão associados aos fatores exógenos expostos: guerra comercial e potencial volatilidade vinda do setor de tecnologia. **Fonte: CENÁRIO ECONÔMICO – Departamento de Pesquisas e Estudos Econômicos - Bradesco.**

## Relatório de Investimentos março de 2018

### 2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	28/02/2018	29/03/2018	jan/18	fev/18	mar/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 373.760.101,21	R\$ 375.713.214,00	0,5742	0,4897	0,5198	1,5921%	1,5921%	8,8000%
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 224.982.780,85	R\$ 224.836.128,98	0,5669	0,4454	0,5176	1,5377%	1,5377%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF M1 TP RF	R\$ 723.415.479,08	R\$ 327.042.615,75	0,5699	0,5338	0,6392	1,7530%	1,7530%	9,1608%
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	R\$ 70.400.284,56	R\$ 70.915.878,73	1,0646	0,6332	0,7299	2,4468%	2,4468%	8,7600%
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF	R\$ 41.795.462,92	R\$ 42.479.247,42	1,0118	0,5388	1,6356	3,2171%	3,2171%	11,6400%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 44.924.276,36	R\$ 45.908.096,40	3,0487	0,4215	2,1918	5,7512%	5,7512%	12,4800%
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO	R\$ 5.059.013,21	R\$ 5.156.789,71	-	1,1803	1,9327	3,1358%	3,1358%	NC
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 178.122,86	R\$ 15.851.112,75	-	0,0830	1,1769	1,2608%	1,2608%	NC
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ -	R\$ 404.034.041,41	-	-	1,0085	1,0085%	1,0085%	NC
SANTANDER FIC FI INST. RF REF DI	R\$ 99.709.431,43	R\$ 100.240.254,56	0,5830	0,4373	0,5319	1,5601%	1,5601%	NC
SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	R\$ 150.000.000,00	R\$ 152.408.711,15	-	-	1,6058	1,6058%	1,6058%	NC
BB PREVID RF IRF M1	R\$ 852.855.083,34	R\$ 657.763.745,00	0,5852	0,5246	0,6338	1,7537%	1,7537%	9,1127%
BB PREVID TP VII	R\$ 30.770.198,71	R\$ 31.159.674,54	1,1718	0,4589	1,2658	2,9225%	2,9225%	10,6676%
BB PREVID TP IX	R\$ 8.441.956,59	R\$ 8.490.290,96	1,0374	0,2434	0,5725	1,8632%	1,8632%	8,6196%
BB PREVID IDKA 2	R\$ -	R\$ 201.751.681,25	-	-	0,8758	0,8758%	0,8758%	NC
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI FI	R\$ 123.840.829,40	R\$ 124.482.050,29	0,5723	0,4538	0,5168	1,5509%	1,5509%	8,2900%
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 54.447.790,27	R\$ 70.655.047,24	1,4858	0,7525	1,0283	3,3008%	3,3008%	NC
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 2.804.580.810,79</b>	<b>R\$ 2.858.888.580,14</b>						

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.

**Nota 2:** Em março/2018, após Deliberação do CODIR em 15/03/2018 sobre adequação da Carteira da Amazonprev ao Cenário atual e registrado na ATA COMIV 136/2018, foram realizadas as aplicações nos fundos BB Previdenciário IDKA 2 e Caixa FI Brasil IMA B5 TP RF LP, nos valores R\$ 200 milhões e R\$ 400 milhões, respectivamente. Os valores migraram de aplicações em fundos indexados ao CDI e IRF M1 nas mesmas instituições.

#### 2.2 EVOLUÇÃO DOS SALDOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXECUTIVO

INSTITUIÇÃO	jan/18	fev/18	mar/18
BRADESCO	R\$ 598.742.882,06	R\$ 598.742.882,06	R\$ 600.549.342,98
CAIXA	R\$ 885.594.516,13	R\$ 885.772.638,99	R\$ 911.387.782,17
BANCO DO BRASIL	R\$ 892.067.238,64	R\$ 892.067.238,64	R\$ 899.165.391,75
ITAÚ	R\$ 178.288.619,67	R\$ 178.288.619,67	R\$ 195.137.097,53
SANTANDER	R\$ 99.709.431,43	R\$ 249.709.431,43	R\$ 252.648.965,71
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 2.654.402.687,93</b>	<b>R\$ 2.804.580.810,79</b>	<b>R\$ 2.858.888.580,14</b>

Quadro 2

## Relatório de Investimentos março de 2018

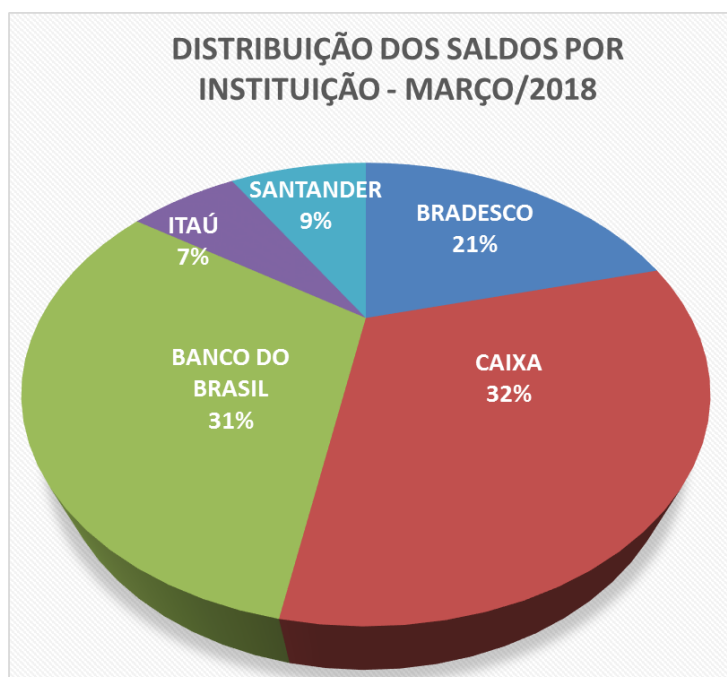


Gráfico 1

### 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\$ 825.271.647,83	28,87%
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	CDI ATIVO	R\$ 157.422.038,72	5,51%
CAIXA FI BRASIL IRF M1 TP RF BB PREVID RF IRF M1	IRF M 1	R\$ 984.806.360,75	34,45%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	IMA B 5	R\$ 556.442.752,56	19,46%
BB PREVID IDKA 2 TP RF	IDKA 2	R\$ 201.751.681,25	7,06%
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\$ 128.037.309,32	4,48%
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO	IBOVESPA ATIVO	R\$ 5.156.789,71	0,18%
<b>TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO</b>		<b>R\$ 2.858.888.580,14</b>	<b>100%</b>

Quadro 3

## Relatório de Investimentos março de 2018

### DISTRIBUIÇÃO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR ÍNDICE - AMAZONPREV

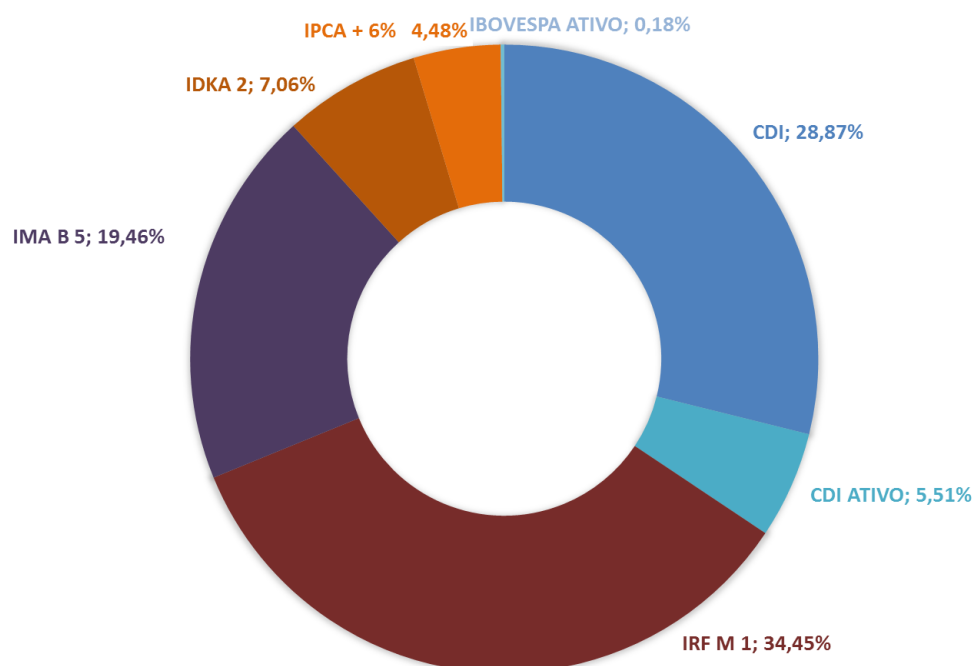


Gráfico 2

### 2.4 COMPARATIVO DOS ÍNDICES DE REFERÊNCIA

ÍNDICE	mar/18	ACUMULADO 2018	12 MESES
CDI	0,5300%	1,5900%	8,4100%
IMA-B 5	1,6202%	3,5306%	11,8952%
IMA-B	0,9355%	4,9412%	10,7562%
IMA B 5+	0,3821%	5,9358%	10,3065%
IRF M 1	0,6576%	1,8017%	9,4150%
IBOVESPA	0,0100%	11,7300%	31,3600%

Quadro 4

## Relatório de Investimentos março de 2018

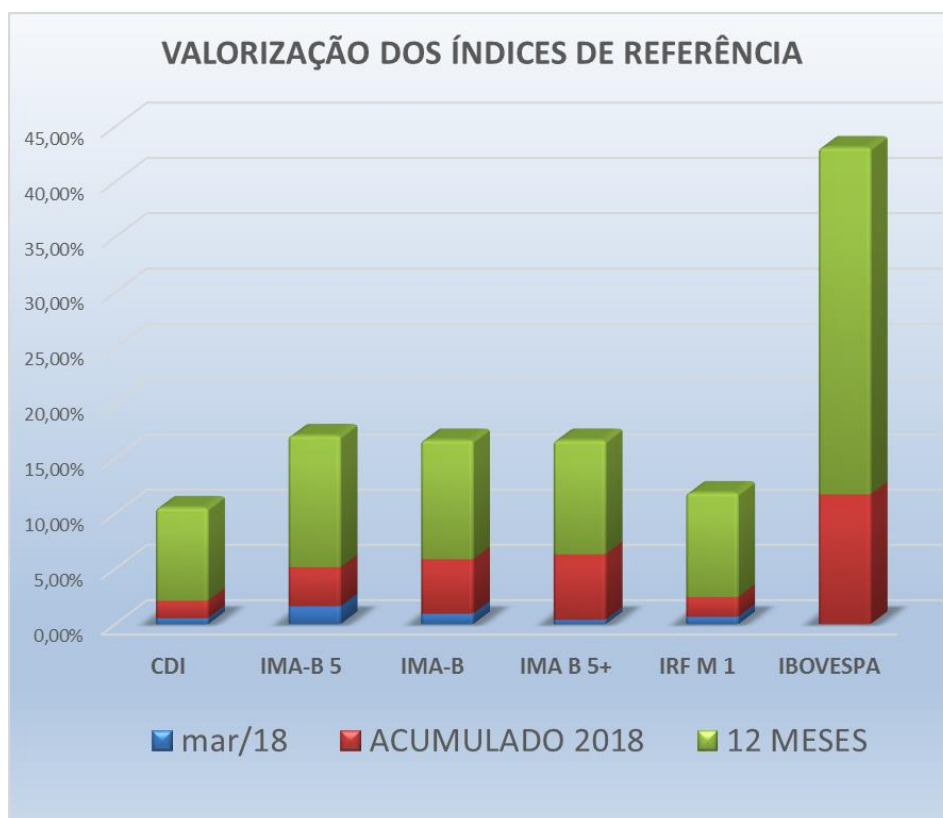


Gráfico 3.

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

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	28/02/2018	29/03/2018	jan/18	fev/18	mar/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 142.567.389,73	R\$ 145.460.795,87	4,4291	0,4295	1,9891	6,9638%	6,9638%	15,8703%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 146.685.525,91	R\$ 147.777.381,57	4,5147	0,1222	0,7389	5,4155%	5,4155%	11,3414%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 148.923.788,37	R\$ 150.032.304,56	4,4185	0,1222	0,7389	5,3185%	5,3185%	11,2389%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 153.825.547,77	R\$ 153.742.055,12	5,6654	0,1591	(0,0543)	5,7760%	5,7760%	11,4927%
<b>TOTAL GERAL</b>	<b>R\$ 592.002.251,78</b>	<b>R\$ 597.012.537,13</b>						

Quadro 5

## Relatório de Investimentos março de 2018

### 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	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO
PREÇO UNITÁRIO DE COMPRA	R\$ 2.314,742871	R\$ 2.288,539269	R\$ 2.235,637189	R\$ 2.254,343911
PREÇO UNITÁRIO ATUAL	R\$ 3.374,960461	R\$ 3.401,090485	R\$ 3.401,090485	R\$ 3.466,562686
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\$ 145.460.795,87</b>	<b>R\$ 147.777.381,57</b>	<b>R\$ 150.032.304,56</b>	<b>R\$ 153.742.055,12</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%
INSTITUIÇÃO CUSTODIANTE	SELIC	SELIC	SELIC	SELIC

Quadro 6

### 2.7 SALDOS CVS - FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	28/02/2018	29/03/2018
CVS - A	R\$ 1.850.865,66	R\$ 1.833.412,34
CVS - B	R\$ 11.977.247,70	R\$ 11.864.269,90
CVS - C	R\$ 240.098,04	R\$ 237.833,96
CVS - D	R\$ 1.313.464,68	R\$ 1.301.075,16
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 15.381.676,08</b>	<b>R\$ 15.236.591,36</b>

Quadro 7

### 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
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 134.838,01</b>	<b>R\$ 435.127,27</b>	<b>R\$ 569.965,28</b>

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
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 53.422,83</b>	<b>R\$ 661.661,60</b>	<b>R\$ 715.084,43</b>

Quadro 9



## Relatório de Investimentos março de 2018

### 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

### 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	0000032	R\$ 53.422,83	R\$ 160.268,49

Quadro 11

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

### 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 março de 2018

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

Valor Global      R\$ 1.605.830,40  
 Valor Mensal      R\$ 133.819,20

2º Aditivo ao Termo de Contrato nº.002/2015-SEAS

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	0017831	R\$ 133.819,20	R\$ (4.460,64)

Quadro 13

### 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

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.

## **Relatório de Investimentos março de 2018**

---

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

## Relatório de Investimentos março de 2018

### 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	
	28/02/2018	29/03/2018
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 2.804.580.810,79	R\$ 2.858.888.580,14
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 592.002.251,78	R\$ 597.012.537,13
TÍTULOS CVS	R\$ 15.381.676,08	R\$ 15.236.591,36
IMÓVEIS	R\$ 64.528.000,00	R\$ 64.528.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 3.850,83	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 3.476.496.589,48</b>	<b>R\$ 3.535.665.708,63</b>

Quadro 16

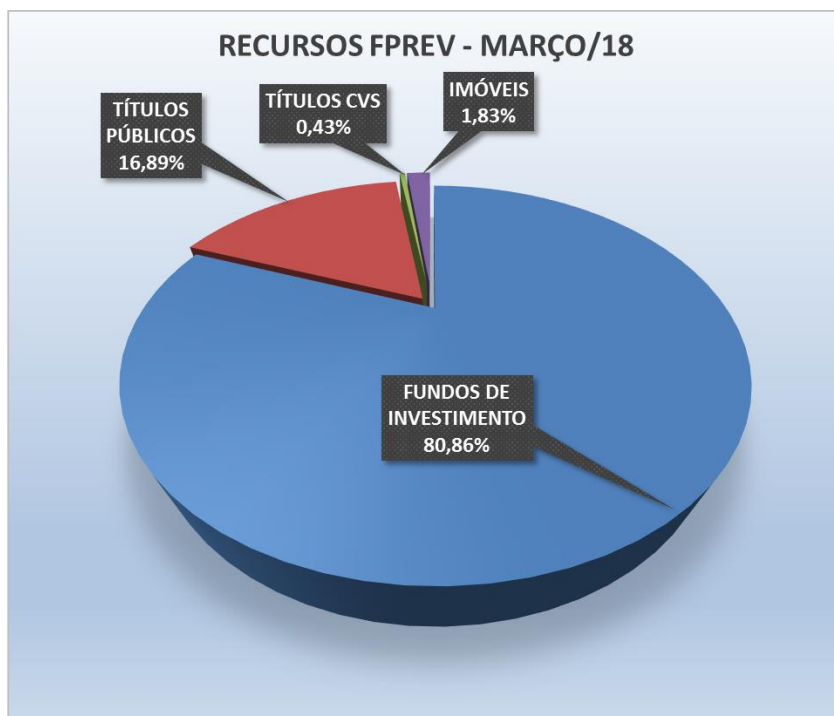


Gráfico 4

## Relatório de Investimentos março de 2018

### 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%
<b>mar/18</b>	<b>R\$ 3.535.665.708,63</b>	<b>1,70%</b>	<b>5,55%</b>	<b>21,86%</b>

Quadro 17

### 2.16 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO

PERÍODO	TAXA
mar/17	0,25%
fev/18	0,32%
<b>março/18</b>	<b>0,09%</b>
Acumulado no ano de 2018	0,70%
Acumulado nos últimos 12 meses	2,68%
<b>Meta Atuarial no mês</b>	<b>0,5772%</b>

Quadro 18

### 2.17 RENTABILIDADE FPREV EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	MAR/18	ACUMULADO 2018	ÚLTIMOS 12 MESES	ACUMULADO 2005 - 2018
RENTABILIDADE DO FPREV	0,8601%	2,6426%	9,5917%	395,3039%
META ATUARIAL	0,5772%	2,1792%	8,8415%	346,5689%
<b>RESULTADO ATUARIAL</b>	<b>0,2813%</b>	<b>0,4536%</b>	<b>0,6892%</b>	<b>10,9132%</b>

Quadro 19

**Nota:** Rentabilidade do FPREV validada pelo atuário.

## Relatório de Investimentos março de 2018

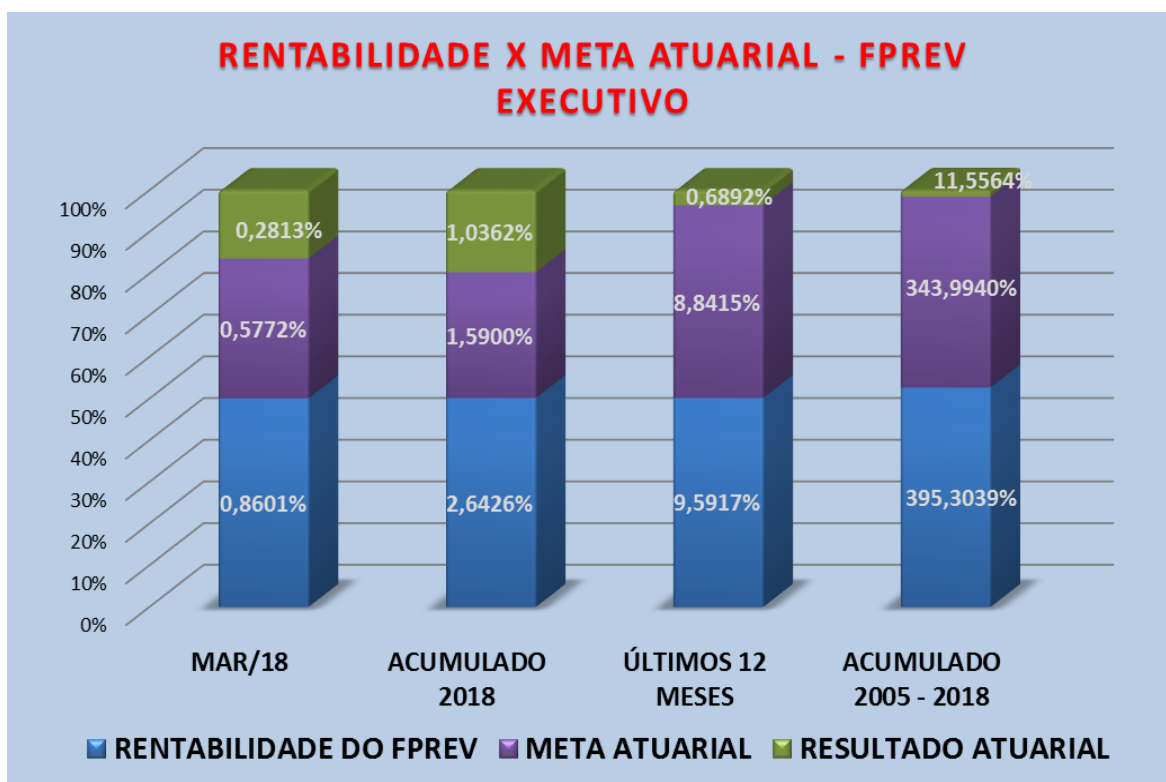


Gráfico 5.

### 3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	28/02/2018	29/03/2018	jan/18	fev/18	mar/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO FI REF DI FEDERAL EXTRA	R\$ 5.909.544,10	R\$ 6.031.864,76	-	0,0971	0,5176	0,6152%	0,6152%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -						
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 5.909.544,10</b>	<b>R\$ 6.031.864,76</b>						

Quadro 20

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

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	28/02/2018	29/03/2018	jan/18	fev/18	mar/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.001.945,15	R\$ 2.016.846,66	4,4185	0,1222	0,7443	5,3243%	5,3243%	11,2365%
<b>TOTAL GERAL</b>	<b>R\$ 2.001.945,15</b>	<b>R\$ 2.016.846,66</b>						

Quadro 21

## Relatório de Investimentos março de 2018

### 3.3 Composição dos Recursos – ALE/FPREV

FUNDO DE INVESTIMENTO	jan/18	fev/18	mar/18
SALDO ANTERIOR	7.574.592,78	7.784.283,78	7.911.489,25
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	89.577,05	89.801,21	91.709,89
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	120.113,95	37.404,26	45.512,28
<b>SALDO FINAL</b>	<b>7.784.283,78</b>	<b>7.911.489,25</b>	<b>8.048.711,42</b>

Quadro 22

### 3.4 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO	
	28/02/2018	29/03/2018
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 5.909.544,10	R\$ 6.031.864,76
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.001.945,15	R\$ 2.016.846,66
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 7.911.489,25</b>	<b>R\$ 8.048.711,42</b>

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%
<b>mar/18</b>	<b>R\$ 8.048.711,42</b>	<b>1,73%</b>	<b>6,26%</b>	<b>26,54%</b>

Quadro 24

### 3.6 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

DESCRIÇÃO	mar/18	ACUMULADO 2018	ÚLTIMOS 12 MESES	ACUMULADO 2012 - 2018
RENTABILIDADE DO FPREV	0,5753%	2,6492%	9,1668%	115,061602%
META ATUARIAL	0,5772%	2,1792%	8,8415%	105,663687%
<b>RESULTADO ATUARIAL</b>	<b>-0,0019%</b>	<b>0,4600%</b>	<b>0,2989%</b>	<b>4,569555%</b>

Quadro 25

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

## Relatório de Investimentos março de 2018

### 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
<b>2018</b>	<b>R\$ 8.048.711,42</b>	<b>R\$ 3.535.665.708,63</b>	<b>R\$ 3.543.714.420,05</b>

Quadro 26

#### 4.2 Rentabilidade Consolidada – ALE FPREV e EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	MAR/18	ACUMULADO 2018	ÚLTIMOS 12 MESES
RENTABILIDADE CONSOLIDADA	0,8595%	2,6426%	9,5938%
META ATUARIAL	0,5772%	2,1792%	8,8415%
<b>RESULTADO ATUARIAL</b>	<b>0,2807%</b>	<b>0,4535%</b>	<b>0,6912%</b>

Quadro 27

### 5. RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

#### 5.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Investimentos – FFIN Executivo

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	28/02/2018	29/03/2018	jan/18	fev/18	mar/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 772.679,13	R\$ 638.453,62	0,5742	0,4400	0,5100	1,5320%	1,5320%	8,4100%
BRDESCO FI RF IRF M1 - COMPREV	R\$ 7.384.465,25	R\$ 7.427.017,40	0,5764	0,5100	0,6451	1,7415%	1,7415%	9,1400%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 764,20						
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 8.157.145,38</b>	<b>R\$ 8.066.235,22</b>						

Quadro 28



## Relatório de Investimentos março de 2018

### 5.2 Disponibilidade Financeira e Cobertura do Déficit – FFIN ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	28/02/2018	29/03/2018
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ -</b>

Quadro 29

### 5.3 Composição do Recursos – FFIN Executivo

FUNDO DE INVESTIMENTO	jan/18	fev/18	mar/18
SALDO ANTERIOR	R\$ 5.127,51	R\$ 0,00	R\$ 0,00
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	R\$ 782.408,91	R\$ 794.524,29	R\$ 800.290,49
COERTURA DO DEFICIT	R\$ 1.253.069,69	R\$ 1.278.753,83	R\$ 1.271.904,84
VARIAÇÃO FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -	R\$ -
SAIDAS FINANCEIRAS	(2.040.606,11)	(2.073.278,12)	(2.072.195,33)
<b>SALDO FINAL</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

Quadro 30

### 5.4 Disponibilidade Financeira – FFIN EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	28/02/2018	29/03/2018
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 131.924,91	R\$ 146.102,21
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ 3.132.558,27	R\$ 14.294,43
REPASSES PATRONAIS	R\$ 1.028.594,00	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.

## 6. TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

### 6.1 SALDOS E PERFORMANCE DOS RECURSOS – TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	28/02/2018	29/03/2018	jan/18	fev/18	mar/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRABESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 798.283,36	R\$ 1.518.689,00	0,5594	0,4400	0,5100	1,5170%	1,5170%	8,4100%
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF	R\$ 27.577.832,54	R\$ 31.463.136,85	0,5699	0,5338	0,6392	1,7530%	1,7530%	9,1608%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 1,00						
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 28.376.116,90</b>	<b>R\$ 32.981.826,85</b>						

Quadro 32

## Relatório de Investimentos março de 2018

### 7. RECURSOS DOS OUTRO PODERES – TJA E TCE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	28/02/2018	29/03/2018	jan/18	fev/18	mar/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FI REF. DI FEDERAL EXTRA	R\$ 91.386.934,96	R\$ 91.693.943,61	-	0,0724	0,5150	0,0724%	0,0724%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TJA	R\$ 124.039.145,07	R\$ 126.329.838,14	0,5699	0,5338	0,6392	1,6808%	1,1067%	9,1608%
BB PREV. RF IRF MI - TJA	R\$ 119.254.559,58	R\$ 121.508.333,81	0,5852	0,5246	0,6337	1,6778%	1,1129%	9,1127%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 1.751,63						
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 334.680.639,61</b>	<b>R\$ 339.533.867,19</b>						

Quadro 33

#### 7.2 Composição dos Saldos - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	jan/18	fev/18	mar/18
SALDO ANTERIOR	325.617.664,11	330.161.670,95	334.680.639,61
REPASSES FINANCEIROS	2.827.643,26	2.892.548,16	3.164.081,68
VARIAÇÃO FINANCEIRA	1.877.282,35	1.762.831,26	1.856.582,55
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(160.918,77)	(136.410,76)	(167.436,65)
<b>SALDO FINAL</b>	<b>R\$ 330.161.670,95</b>	<b>R\$ 334.680.639,61</b>	<b>R\$ 339.533.867,19</b>

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					
	28/02/2018	29/03/2018	jan/18	fev/18	mar/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FI REF. DI FEDERAL EXTRA	R\$ 40.195.978,05	R\$ 40.404.039,18	-	0,0724	0,5150	0,0724%	0,0724%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TCE	R\$ 51.128.936,54	R\$ 51.800.096,87	0,5699	0,5338	0,6392	1,7530%	1,7530%	9,1608%
BB PREV. RF IRF MI - TCE	R\$ 49.172.858,30	R\$ 50.254.380,76	0,5852	0,5246	0,6337	1,6778%	1,1129%	9,1127%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -						
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 140.497.772,89</b>	<b>R\$ 142.458.516,81</b>						

Quadro 35

#### 7.4 Composição dos Saldos - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	jan/18	fev/18	mar/18
SALDO ANTERIOR	137.668.973,81	138.590.015,40	140.922.470,70
REPASSES FINANCEIROS	-	1.699.170,66	829.616,37
VARIAÇÃO FINANCEIRA	1.034.251,78	742.911,02	848.030,07
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(113.210,19)	(109.626,38)	(141.600,33)
<b>SALDO FINAL</b>	<b>R\$ 138.590.015,40</b>	<b>R\$ 140.922.470,70</b>	<b>R\$ 142.458.516,81</b>

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.

## Relatório de Investimentos março de 2018

### 8. ENQUADRAMENTO

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% DA CARTEIRA	LIMITADA RESOLUÇÃO	Res. n° 3.922/2010 atualizada pela Res. n° 4.604/2017
TÍTULOS DO TN	R\$ 599.029.383,79	14,97%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 829.526.459,57	56,67%	100,00%	art. 7º, inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 31.159.674,54			
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ 8.490.290,96			
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 201.751.681,25			
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 152.408.711,15			
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 15.851.112,75			
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 536.635.687,61			
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 404.034.041,41			
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 42.479.247,42			
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 45.908.096,40			
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.157.142,62	27,85%	40%	art. 7º, inciso IV, "a"
BRADERCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 362.965.976,53			
BRADERCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 375.713.214,00			
BRADERCO FI RF IRFM 1	R\$ 7.427.017,40			
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 70.655.047,24			
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	R\$ 70.915.878,73			
SANTANDER FIC INST. RF REF DI	R\$ 100.240.254,56			
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI	R\$ 124.482.050,29			
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.156.789,71	0,13%	10%	art. 8º, inciso III
TÍTULOS CVS	R\$ 15.236.591,36	0,38%	-	TÍTULO NÃO REGISTRADO NO SELIC
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 4.002.224.349,29</b>	<b>100,00%</b>		

Quadro 37

#### 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. n° 3.922/2010 atualizada pela Res. n° 4.604/2017
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.157.142,62	R\$ 4.002.387.262,76	0,05%	20%
BRADERCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 362.965.976,53		9,07%	
BRADERCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 375.713.214,00		9,39%	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 70.655.047,24		1,77%	
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI	R\$ 124.482.050,29		3,11%	
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	R\$ 70.915.878,73		1,77%	
SANTANDER FIC INST. RF REF DI	R\$ 100.240.254,56		2,50%	
BRADERCO FI RF IRFM 1	R\$ 7.427.017,40		0,19%	

Quadro 38

## Relatório de Investimentos março de 2018

**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	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Res. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 829.526.459,57	11.779.556.526,80	7,04%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 31.159.674,54	1.159.373.584,73	2,69%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ 8.490.290,96	352.834.074,63	2,41%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 201.751.681,25	6.069.165.847,64	3,32%	
SANTANDER FIC INST. REF DI	R\$ 100.240.254,56	5.012.799.392,44	2,00%	
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 152.408.711,15	1.290.858.853,55	11,81%	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 70.655.047,24	1.220.362.845,36	5,79%	
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI	R\$ 124.482.050,29	1.229.962.648,87	10,12%	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 536.635.687,61	16.025.812.129,49	3,35%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 404.034.041,41	7.642.122.550,69	5,29%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 15.851.112,75	1.306.794.934,83	1,21%	
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	R\$ 70.915.878,73	1.318.430.865,83	5,38%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 42.479.247,42	248.715.736,11	17,08%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 45.908.096,40	187.350.043,16	24,50%	
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESA II	R\$ 5.156.789,71	257.392.192,48	2,00%	
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 362.965.976,53	5.997.534.136,46	6,05%	
BRADESCO FI RF IRFM 1	R\$ 7.427.017,40	675.608.799,39	1,10%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.157.142,62	309.759.292,61	0,70%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 375.713.214,00	8.893.322.367,31	4,22%	

Quadro 39

**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.

## Relatório de Investimentos março de 2018

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA FEV/18) EM R\$ BI	TOTAL RECURSOS - AMAZONPREV	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Res. n.º 3.922/2010 atualizada pela Res. n.º 4.604/2017
BB DTVM S.A	R\$ 880.250,13	R\$ 869.176.425,07	0,0987%	5%
BRADESCO	R\$ 603.730,36	R\$ 748.263.350,55	0,1239%	
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 610.566,21	R\$ 195.137.097,53	0,0320%	
CAIXA	R\$ 287.751,34	R\$ 716.946.812,62	0,2492%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	R\$ 259.931,76	R\$ 252.648.965,71	0,0972%	

#### 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 março de 2018

### 9. TOTAL DOS RECURSOS - AMAZONPREV

#### FPREV PODER EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 2.858.888.580,14
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 597.012.537,13
CVS	R\$ 15.236.591,36
IMÓVEIS	R\$ 64.528.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 3.535.665.708,63</b>

#### ASSEMBLEIA LEGISLATIVA - ALE FPREV E ALE FFIN

DESCRIÇÃO	SALDO
ALE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 6.031.864,76
ALE FPREV TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.016.846,66
ALE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
ALE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ -
ALE FFIN DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 8.048.711,42</b>

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

DESCRIÇÃO	SALDO
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	R\$ 32.981.825,85
FUNDO FINANCEIRO - EXECUTIVO	R\$ 638.453,62
FUNDO FINANCEIRO - COMPREV	R\$ 7.427.017,40
DISP. FINANCEIRA - TAXA DE ADM.	R\$ 1,00
DISP. FINANCEIRA - FFIN	R\$ 764,20
DISP. FINANCEIRA - REP. COBERT. DEFICIT	R\$ 14.294,43
DISP. FINANCEIRA - SAL. NÃO RECLAMADOS	R\$ 146.102,21
DISP. REPASSES PATRONAIS	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 41.208.458,71</b>

#### OUTROS PODERES

ORGÃOS	SALDO
TJ/AM	R\$ 339.532.115,56
TCE/AM	R\$ 142.458.516,81
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA/TCE	R\$ 1.751,63
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 481.992.384,00</b>
<b>TOTAL GERAL</b>	<b>4.066.915.262,76</b>

Quadro 41

## Relatório de Investimentos março de 2018

### 9.1 CONSOLIDADO DOS RECURSOS - AMAZONPREV

#### CONSOLIDADO DOS RECURSOS - MAR/2018

DESCRIÇÃO	FPREV PODER EXECUTIVO	FPREV - ALE	TOTAL - FPREV
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 2.858.888.580,14	R\$ 6.031.864,76	R\$ 2.864.920.444,90
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 597.012.537,13	R\$ 2.016.846,66	R\$ 599.029.383,79
CVS	R\$ 15.236.591,36	R\$ -	R\$ 15.236.591,36
IMÓVEIS	R\$ 64.528.000,00	R\$ -	R\$ 64.528.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 3.535.665.708,63</b>	<b>R\$ 8.048.711,42</b>	<b>R\$ 3.543.714.420,05</b>

DESCRIÇÃO	FFIN - PODER EXECUTIVO	FFIN - ALE	TOTAL FFIN
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 638.453,62	R\$ -	R\$ 638.453,62
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 764,20	R\$ -	R\$ 764,20
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 639.217,82</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ 639.217,82</b>

DESCRIÇÃO	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	SALARIOS NÃO RECLAMADOS	TOTAL OUTROS RECURSOS
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 32.981.825,85	R\$ -	R\$ 32.981.825,85
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 146.102,21	R\$ 146.103,21
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 32.981.826,85</b>	<b>R\$ 146.102,21</b>	<b>R\$ 33.127.929,06</b>

DESCRIÇÃO	COMPREV	DISP. COBERTURA DEFICIT E REPASSE PATRONAIS	TOTAL OUTROS RECURSOS
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 7.427.017,40	R\$ -	R\$ 7.427.017,40
DISP. FINANCEIRA - REP. COBERT. DEFICIT	R\$ -	R\$ 14.294,43	R\$ 14.294,43
DISP. REPASSES PATRONAIS	R\$ -	R\$ -	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 7.427.017,40</b>	<b>R\$ 14.294,43</b>	<b>R\$ 7.441.311,83</b>

DESCRIÇÃO	RECURSOS TJ/AM	RECURSOS TCE/AM	RECURSOS TCE/AM
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 339.532.115,56	R\$ 142.458.516,81	R\$ 481.990.632,37
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1.751,63	R\$ -	R\$ 1.751,63
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 339.533.867,19</b>	<b>R\$ 142.458.516,81</b>	<b>R\$ 481.992.384,00</b>

<b>TOTAL DOS RECURSOS - AMAZONPREV</b>	<b>R\$ 4.066.915.262,76</b>
--	-----------------------------

Quadro 42

## Relatório de Investimentos março 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