



GOVERNO DO ESTADO DO AMAZONAS

AMAZONPREV

Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



RELATÓRIOS - 2021

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Abril / 2021

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <http://www.portaldosegurado.am.gov.br:85/validar>
 e valide o código: NTE0MTE



Destino: DIRAF / PRESI

Assunto: **Relatório de Investimentos – Abril/2021**

Data: 17/05/2021

RELATÓRIO Nº. 05 / 2021 – COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **abril/2021**, destacando:

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 03 a 06);
- 2) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Poder Executivo, apresentando os saldos e **performance** dos Fundos de Investimentos, evolução dos saldos dos Fundos de Investimentos, imóveis e CVS, comparativo da rentabilidade com a Meta Atuarial, Evolução e variação dos recursos do FPREV Executivo (páginas 07 a 12)
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 13 a 14)
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (página 15)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (página 16)
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (página 17 a 18)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (página 19 a 20)
- 8) Rentabilidade do Fundo Previdenciário - Consolidado – FPREV (página 21 a 22)
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro – (páginas 23 a 24)
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (páginas 24 a 25)
- 11) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 26 a 31)
- 12) Total dos Recursos e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 31 a 32)
- 13) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 33)
- 14) Relatório de Riscos da Carteira (página 34 a 39)
- 15) Parecer do Comitê de Investimentos (página 40).
- 16) Parecer do Conselho Fiscal (página 41).
- 17) Parecer do Conselho de Administração (página 42).

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <http://www.portaldossegurado.am.gov.br:85/validar>
e valide o código: NTE0MTE



1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

Com apoio dos Relatórios: Carta do Gestor e Síntese Mensal, emitidos pela BRAM Asset Management:

BRASIL: Inflação melhora na margem, mas cenário de médio prazo segue desfavorável

MUNDO: Fed reconhece atividade forte, mas mantém postura paciente com a inflação

Em abril, a prévia da inflação ao consumidor (IPCA-15) ficou ligeiramente abaixo do esperado. Nessa divulgação, o índice subiu 0,60% na comparação mensal, resultado um pouco aquém das expectativas (0,63%) e da mediana do mercado (0,66%). A abertura entre os grupos mostrou melhora disseminada, com destaque para o arrefecimento da inflação de combustíveis. A alto do etanol, por exemplo, cedeu de 12,6% em março para 1,5% nessa leitura. No caso da inflação de alimentos, a variação mensal foi de 0,36%, praticamente em linha com a projeção de 0,31%. Com relação aos núcleos, que são métricas que excluem ou suavizam itens com inflação volátil, a leitura de março mostrou uma leve melhora na margem, em especial das medidas de inflação subjacente acompanhadas pelo Banco Central. De toda forma, elas seguem em patamar elevado.

O cenário de médio prazo, contudo, evoluiu desfavoravelmente. O mais recente movimento de alta de preços de commodities, a retomada dos pagamentos do auxílio emergencial e a antecipação do 13º salário dos aposentados impõem uma trajetória menos benigna para a inflação nos próximos meses. Além disso, há incerteza sobre a capacidade da indústria de suprir a demanda aquecida por bens, em um cenário de baixos estoques e elevação de custos de produção. A recente valorização do câmbio, por sua vez, deve atenuar esse movimento. A projeção para o IPCA no ano é de 5,2%.

O Índice do Banco Central de atividade (IBC-Br) avançou 1,7% na margem em fevereiro. O indicador prévio do PIB registrou alta acima de nossa projeção (1,0%), e da mediana do mercado (0,9%). O resultado refletiu as altas das vendas no varejo ampliado (4,1%) e do volume de serviços (3,7%) no mês, contrabalançadas pela queda da produção industrial (de -0,7%). Vale notar, no entanto, que boa parte da alta das séries de comércio e serviços com ajuste sazonal se deu num contexto atípico, em um mês no qual o feriado de Carnaval foi suspenso em parte do país. Na comparação interanual, o índice teve alta de 1,0%. O IBC-Br já se situa 2,7% acima do patamar pré-pandemia (média de janeiro e fevereiro de 2020) e a média de janeiro e fevereiro representa crescimento de 2,9% em relação ao último trimestre de 2020. No entanto, os dados de março e abril deverão sofrer o impacto das novas restrições de mobilidade decorrentes da piora da pandemia.

Nos EUA, o Fed manteve a taxa de juros entre 0% a.a e 0,25% a.a e reconheceu a melhora recente no cenário diante do avanço da vacinação e dos estímulos fiscal e monetário. O banco central americano reafirmou que manterá o patamar da taxa de juros e o programa de US\$120 bilhões mensais em compra de



ativos, até avanço substancial em direção ao alcance das metas de pleno emprego e da estabilidade de preços. No comunicado, o Fed destacou que a inflação avançou, mas em decorrência de eventos transitórios. Na entrevista após a reunião, o presidente do Fed, Jerome Powell, revelou que a recuperação econômica segue incompleta e que, portanto, qualquer discussão sobre a retirada de estímulos é prematura. Sobre a dinâmica de inflação, Powell defende que o Fed deve ser paciente, não reagindo aos movimentos transitórios de alta nos preços. O Fed segue com uma postura cautelosa acerca da diminuição dos estímulos. Avalia-se que esse debate se tornará mais intenso a partir do 3º trimestre, com potencial redução das compras de ativos a partir do início de 2022.

O Banco Central Europeu (BCE) reafirmou a alteração recente na política de compra de ativos. Em reunião com poucas novidades, o BCE manteve o patamar da taxa de depósito em -0,5%, da taxa de refinanciamento em 0,0% e da taxa de empréstimo em 0,25%. O total do Programa Pandêmico de Compras Emergenciais (PEPP na sigla em inglês) foi mantido em € 1,85 trilhão em compra de ativos, com horizonte de compras até março de 2022 ou até o BCE julgar que a crise atual tenha se encerrado. Mas, assim como na reunião anterior, o BCE afirmou que prevê um ritmo mensal de compras mais forte no segundo trimestre na comparação com os primeiros meses do ano. O valor exato do ritmo não foi detalhado pelo comitê no documento, mas o volume semanal de compras já aumentou em cerca de 20% desde março. A intenção do BCE com essa aceleração é manter as condições financeiras expansionistas, a fim de favorecer o alcance da meta de inflação no médio prazo. Avalia-se que, dada a resistência da inflação a subir, os estímulos monetários devem ser mantidos por período prolongado.

Com relação à atividade econômica, os EUA caminham para uma recuperação mais rápida do que a Zona do Euro. O PIB americano teve crescimento de 1,6% na margem no 1º trimestre de 2021. O resultado representou aceleração ante o trimestre anterior (1,1%). Entre os componentes do indicador, o consumo das famílias teve alta de 2,6% e o investimento avançou 2,4%, com destaque para equipamentos tecnológicos e software. Apesar do bom resultado, o PIB ainda se mantém 0,9% abaixo do nível do final de 2019. Esperado avanço de 2,5% no PIB do segundo trimestre e alta de 6,5% no ano de 2021, ante queda de 3,5% em 2020. Em direção oposta, a Zona do Euro entrou em recessão técnica, com dois trimestres consecutivos de recuo no PIB. Em virtude do recrudescimento da pandemia e das medidas de restrições à mobilidade, o PIB da região contraiu 0,6% no 1º trimestre, após recuo de 0,7% no trimestre anterior. A atividade na Alemanha foi a mais prejudicada no período, com recuo de 1,7%. O PIB da Zona do Euro segue 5,6% abaixo do nível do final de 2019, mas deve ter melhora à frente, dado alívio às restrições de mobilidade e o avanço na vacinação. No ano, o PIB da Zona do Euro deverá apresentar expansão de 3,5%.

Perspectivas Renda Fixa – É possível perceber um crescimento mais forte das economias desenvolvidas e, conseqüentemente, os dados de atividade da indústria e serviços têm demonstrado um melhor desempenho, além de choques inflacionários com grande contribuição por parte das commodities.



Adicionalmente, o FED ainda não se posicionou com relação a um enxugamento de liquidez e, com esse movimento, manteve as taxas baixas no curto prazo e a economia ainda bastante estimulada. Para frente, as atenções se voltam para a Europa, onde se espera um aumento na velocidade da vacinação. No local, cresce o sentimento de que uma recuperação mais forte da economia possa ocorrer após a reabertura e, corroborando com isso, uma vacinação mais intensa. O risco latente na parte fiscal continua, porém, o orçamento foi aprovado sem um descumprimento do teto. A inflação segue mais forte, com impacto relevante de commodities e com a leitura de atividade no mesmo sentido, entretanto com problemas de ofertas para a indústria. Dito isso, a gestão entende que o Banco Central não fará esse movimento de ajuste de política monetária de forma parcial, mas sim levará a SELIC para um nível neutro. A expectativa é que a taxa básica de juros atinja 6,25% no final do ano. Neste mês, finalmente a abertura da curva cessou e trazendo um certo alívio. Os motivos são o arrefecimento nas taxas das treasuries e o otimismo com relação a uma recuperação mais intensa. Destaques para os ativos mais longos prefixados e ativos de curto prazo atrelados à inflação. Por fim, foi um mês positivo para todos os ativos de renda fixa, com exceção do IMA S, índice que representa as LFTs, teve mais um mês abaixo do CDI, aproximadamente 35% do CDI. A curva de juros prefixado caiu principalmente nos vértices intermediários e longos. Nos ativos atrelados à inflação, a curva caiu nos vértices mais curto e intermediários enquanto os mais longos permaneceram inalterados. É importante salientar que esses ativos atrelados à inflação se beneficiam de uma continuidade do aumento da inflação. Outro ativo que trouxe alívio adicional foi o dólar que cedeu mais de 5% nesse mês fechando o mês em R\$ 5,4036.

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA FIXA



Fonte: Carta ao Gestor_BRAM - Maio/2021

Perspectivas Renda Variável – Abril seguiu positivo para as bolsas em geral. Apesar das preocupações em torno da volta da inflação e de altas de juros no futuro, a abundante liquidez e a perspectiva de novos incentivos estimulam as bolsas dos países desenvolvidos a alcançar novos recordes. O S&P 500 teve retorno

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <http://www.portaldosegurado.am.gov.br:85/validar>
 e valide o código: NTE0MTE



de 5,24%, o Nasdaq teve retorno de 5,40% e o MSCI Emerging Markets 2,37% acumulando alta no ano de 12,98%, 9,96% e 3,31% respectivamente e em moeda original. O Ibovespa teve mais um mês recuperação com retorno positivo de 1,94%. O fluxo do investidor estrangeiro voltou ser positivo, em linha com o mercado de capitais que permanece aquecido. A menor lotação nos hospitais e o avanço das vacinas têm proporcionado ambiente de menor pessimismo para a economia. A gestão segue com visão positiva para renda variável no médio e longo prazos, onde pode se destacar fatores como crescimento cíclico do PIB e juros em patamares baixos considerando a normalização da Selic anunciada pelo BCB, trazendo fluxo do investidor local para a bolsa. Atrasos no cronograma de vacinação contra COVID 19 assim como eventuais dificuldades na recuperação da economia brasileira permanecem como pontos de atenção no curto prazo. Para a gestão, o balanço de forças entre a expectativa de novos pacotes de estímulo fiscal nos EUA e o ambiente local justificam a adoção de portfólios balanceados em empresas ligadas a commodities e as expostas ao consumo doméstico, com expectativa de crescimento acima do mercado, potencial de consolidação e bem posicionadas para os desafios que temos pela frente. Sobre a performance dos diferentes setores, os temas de reabertura e recuperação das economias local e global permanecem sendo os principais influenciadores do comportamento do preço das ações (setor de Mineração e Siderurgia). Operações de fusões e aquisições também tem influenciado o mercado (setor de Varejo). Na visão da gestão, o mercado está antecipando a dinâmica de volta a normalidade na economia, mas permanece o risco de efeitos colaterais provenientes do período de medidas distanciamento social (Setor de Shoppings Properties por exemplo).

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA VARIÁVEL

	ABRIL	2021	12 MESES	24 MESES	36 MESES
S&P 500 USD	5,24%	11,32%	43,56%	41,94%	57,90%
MSCI WORLD USD	4,52%	9,25%	43,16%	34,89%	40,85%
SMLL	4,38%	3,46%	55,90%	48,74%	65,09%
IBRX100	2,84%	2,09%	51,24%	28,38%	44,99%
IDIV11	2,03%	-1,25%	37,02%	27,18%	51,25%
IBOVESPA	1,94%	-0,10%	47,68%	23,39%	38,06%

Fonte: Carta ao Gestor_BRAM - Maio/2021.

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <http://www.portaldosegurado.am.gov.br:85/validar>
 e valide o código: NTE0MTE



2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

2.1 SALDOS E PERFORMANCE RENDA FIXA

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/03/2021	30/04/2021	fev/21	mar/21	abr/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 323.104.855,81	R\$ 325.112.833,57	(0,9139)	(0,4211)	0,6214	-0,7180%	-1,2664%	4,0452%	
BB PREVID TP VII	R\$ 6.917.542,68	R\$ 6.945.557,64	(0,0122)	0,3900	0,4049	0,7842%	1,0731%	7,3864%	
BB PREVID IDKA 2	R\$ 242.498.686,68	R\$ 256.914.249,78	(0,5482)	0,3700	0,8398	0,6581%	0,8361%	NC	
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 3.810.813,16	R\$ 3.817.400,24	0,0800	0,1900	0,1700	0,4406%	0,5913%	1,5535%	
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 52.598.778,27	R\$ 53.379.206,77	(3,8000)	0,0700	1,4800	-2,3079%	-2,4642%	4,2430%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 480.385.103,60	R\$ 484.524.336,27	(0,6197)	0,3115	0,8616	0,5488%	0,6325%	8,6228%	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 527.662.583,20	R\$ 531.169.049,32	(0,5075)	0,3010	0,6645	0,4551%	0,4805%	4,6296%	
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 27.850.646,66	R\$ 28.193.521,51	(0,5300)	0,3300	1,2300	1,0258%	1,3794%	11,6933%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 108.518.916,55	R\$ 109.469.933,64	(0,6400)	0,2800	0,8800	0,5150%	0,5753%	8,4745%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 60.340.348,32	R\$ 60.597.964,35	(2,3500)	(1,2150)	0,4300	-3,1217%	-4,7976%	9,9212%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 21.146,55	R\$ 21.169,27	0,0600	0,1400	0,1100	0,3103%	0,4446%	2,0150%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 28.510.074,44	R\$ 28.680.250,82	(1,8600)	(0,8158)	0,5969	-2,0796%	-3,7149%	8,0272%	
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 1.862.219.495,92	R\$ 1.888.825.473,18							

Quadro 1.

2.2 SALDOS E PERFORMANCE RENDA VARIÁVEL

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/03/2021	30/04/2021	fev/21	mar/21	abr/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 130.532.819,40	R\$ 133.566.136,82	(5,0279)	8,6306	2,3237	5,5661%	-0,3311%	48,8764%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 168.990.880,35	R\$ 176.326.547,56	(0,7700)	3,1200	4,3400	6,7669%	3,9162%	39,1207%	
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 59.790.100,24	R\$ 61.698.133,81	(3,0900)	4,0800	3,1900	4,0815%	0,6364%	48,3833%	
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 329.164.803,58	R\$ 332.437.979,27	(2,5279)	1,7300	0,9943	0,1443%	-0,4722%	42,4200%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FI AÇÕES	R\$ 9.803.850,19	R\$ 9.811.239,07	(4,1513)	8,1740	0,0754	3,7616%	0,0366%	NC	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 6.779.153,09	R\$ 6.745.596,57	(0,2364)	22,2300	(0,4950)	21,3374%	21,1311%	NC	
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 62.161.026,99	R\$ 42.912.258,65	(5,3612)	2,1311	0,7668	-2,6032%	-3,9420%	27,1753%	
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 178.384.246,29	R\$ 181.362.620,28	(3,8100)	5,0600	1,6700	2,7449%	-1,2827%	27,6652%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 174.167.462,84	R\$ 179.936.971,66	0,4700	2,1200	3,3100	5,9960%	4,4485%	47,1300%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 39.901.426,98	R\$ 41.031.880,04	(3,8500)	3,8900	2,8300	2,7171%	0,3135%	44,0660%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 62.960.380,35	R\$ 65.634.685,83	(4,3000)	3,5800	4,2500	3,3389%	0,3318%	35,3159%	
ITAU SMALL CAPS VALUATION	R\$ 86.364.720,04	R\$ 91.901.452,76	(0,6600)	4,5800	6,4100	10,5491%	7,9733%	56,7547%	
SANTANDER CRESCE SENIOR (TOP AÇÕES)	R\$ 14.617,90	R\$ 14.863,70	(4,2863)	6,4746	(3,0873)	-1,2355%	-4,2537%	34,9917%	
SANTANDER SEL CRESCIMENTO (SELEÇÃO 30)	R\$ 45.988.315,18	R\$ 46.766.080,07	(4,2868)	1,4842	1,6912	-1,2235%	-4,2188%	35,0765%	
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 23.088.119,79	R\$ 24.325.680,39	2,5900	4,0700	5,3602	12,4883%	12,2858%	42,5536%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 84.376.765,95	R\$ 90.230.730,64	0,7727	0,7675	6,9400	8,5934%	6,5193%	NC	
OCCAM FIC FIA	R\$ 128.504.904,80	R\$ 133.018.999,61	(3,3629)	3,9351	3,5100	3,9653%	0,7112%	NC	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 32.217.327,79	R\$ 32.866.562,83	(3,4898)	2,5179	2,0152	0,9341%	-2,3518%	NC	
BRASIL CAPITAL RP INSTIT FIC AÇÕES	R\$ -	R\$ 9.878.845,32	-	-	(1,5200)	-1,5200%	-1,5200%	NC	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ -	R\$ 10.113.585,56			2,3100	2,3100%	2,3100%	NC	
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.623.190.921,75	R\$ 1.670.580.850,44							

Quadro 2.



2.3 SALDOS E PERFORMANCE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/03/2021	30/04/2021	fev/21	mar/21	abr/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 82.654.069,79	R\$ 83.465.235,65	6,1534	3,8559	0,9813	11,3284%	16,7803%	NC	
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 141.372.070,13	R\$ 142.851.062,63	4,5987	2,5800	0,7828	8,1373%	14,2333%	NC	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 40.682.977,71	R\$ 28.983.588,91	-	1,9353	1,2400	3,1993%	3,1993%	NC	
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 79.949.515,64	R\$ 80.255.295,41	4,0790	3,8344	0,3824	8,4831%	14,0029%	NC	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 136.158.010,05	R\$ 139.790.869,53	4,4700	3,0300	2,6681	10,5073%	14,6513%	NC	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 20.971.787,48	R\$ 35.564.693,58	-	1,6361	1,0716	2,7252%	2,7252%	NC	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 20.289.668,37	R\$ 34.300.753,66	-	(1,6697)	0,7681	-0,9144%	-0,9144%	NC	
TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	R\$ 522.078.099,17	R\$ 545.211.499,37							
TOTAL GERAL	R\$ 4.007.488.516,84	R\$ 4.104.617.822,99							

Quadro 3.

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 172/2020, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Resgatar R\$ 30 milhões do fundo CAIXA FI AÇÕES CONSUMO (10.577.512/0001-79), rateando entre os fundos VINCI SELECTION EQUITIES FI (15.603.945/0001-75), BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA (15.603.945/0001-75) e BNP PARIBAS ACTION FIC FI (12.239.939/0001-92), somente este ainda pendente.

2.4 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

INSTITUIÇÃO	fev/21	mar/21	abr/21
BRADERCO	R\$ 223.331.889,60	R\$ 232.591.793,75	R\$ 241.842.081,61
BANCO DO BRASIL	R\$ 850.037.098,57	R\$ 865.657.490,00	R\$ 886.259.308,87
CAIXA	R\$ 1.129.396.013,18	R\$ 1.122.807.492,06	R\$ 1.111.984.851,01
ITAÚ	R\$ 352.350.089,94	R\$ 363.415.136,76	R\$ 378.526.159,56
SANTANDER	R\$ 183.694.505,44	R\$ 187.375.722,51	R\$ 189.632.006,40
ICATU	R\$ 366.921.096,37	R\$ 375.094.157,82	R\$ 379.624.039,78
SAFRA	R\$ 183.922.837,77	R\$ 187.756.204,28	R\$ 192.796.800,74
BTG PACTUAL	R\$ 338.190.491,48	R\$ 345.747.806,86	R\$ 348.994.814,91
AZ QUEST	R\$ 83.734.069,33	R\$ 84.376.765,95	R\$ 90.230.730,64
OCCAM BRASIL	R\$ 123.639.527,85	R\$ 128.504.904,80	R\$ 133.018.999,61
SCHRODER	R\$ 24.505.010,57	R\$ 40.682.977,71	R\$ 28.983.588,91
SULAMÉRICA	R\$ 31.426.044,40	R\$ 32.217.327,79	R\$ 32.866.562,83
PLURAL INVEST	R\$ -	R\$ 41.261.455,85	R\$ 69.865.447,24
BRASIL CAPITAL	R\$ -	R\$ -	R\$ 9.878.845,32
VINCI PARTNERS	R\$ -	R\$ -	R\$ 10.113.585,56
TOTAL	R\$ 3.891.148.674,52	R\$ 4.007.489.236,14	R\$ 4.104.617.822,99

Quadro 4.



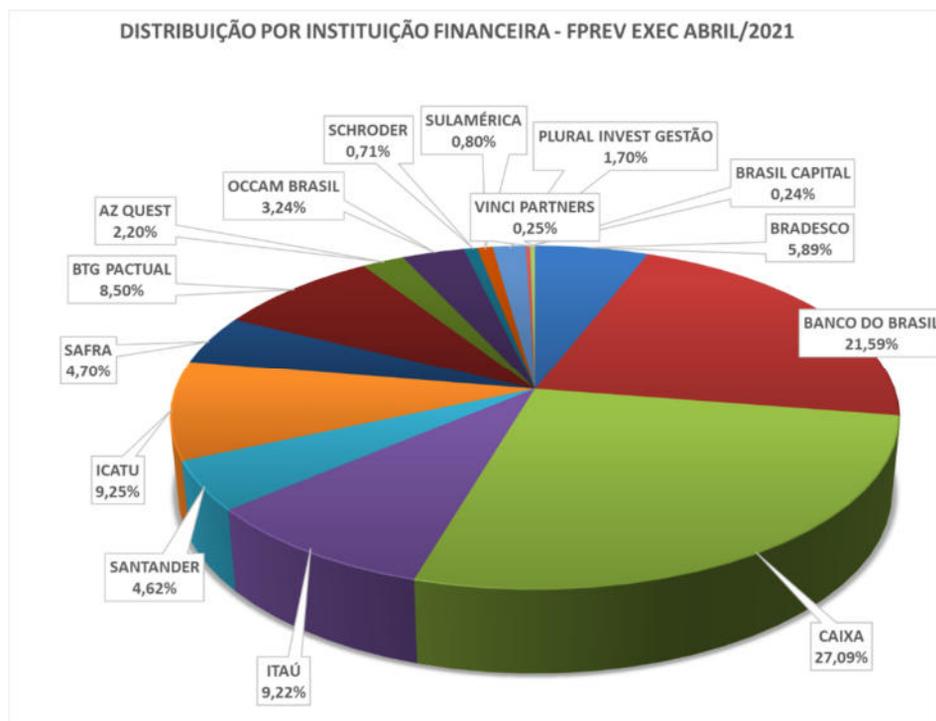


Gráfico 1.

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/03/2021	30/04/2021	fev/21	mar/21	abr/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 162.171.873,72	R\$ 163.527.991,19	1,3891	1,4595	0,8362	3,729%	4,5339%	13,6772%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 169.115.058,38	R\$ 170.545.216,52	1,3986	1,4690	0,8457	3,758%	4,5731%	13,8051%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 177.957.730,08	R\$ 179.504.729,94	1,4224	1,4928	0,8693	3,831%	4,6712%	14,1255%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 175.484.877,56	R\$ 176.968.931,13	1,3986	1,4690	0,8457	3,758%	4,5732%	13,8053%
TOTAL GERAL	R\$ 684.729.539,73	R\$ 690.546.868,78						

Quadro 5.

Nota: Títulos Públicos atualizados pelo valor de aquisição acrescido da taxa de juros. (Ver quadro 6).

2.6 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
TIPO DE ATIVO	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B
INTERMEDIÁRIO	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO
PREÇO UNITÁRIO DE COMPRA	R\$ 2.314,742871	R\$ 2.288,539269	R\$ 2.235,637189	R\$ 2.254,343911
QUANTIDADE	43.100	43.450	44.113	44.350
APLICAÇÃO INICIAL	R\$ 99.765.417,74	R\$ 99.437.031,23	R\$ 98.620.663,31	R\$ 99.980.152,45
VALOR ATUAL	R\$ 163.527.991,19	R\$ 170.545.216,52	R\$ 179.504.729,94	R\$ 176.968.931,13
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 6.

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <http://www.portaldosegurado.am.gov.br:85/validar>
 e valide o código: NTE0MTE



2.7 ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

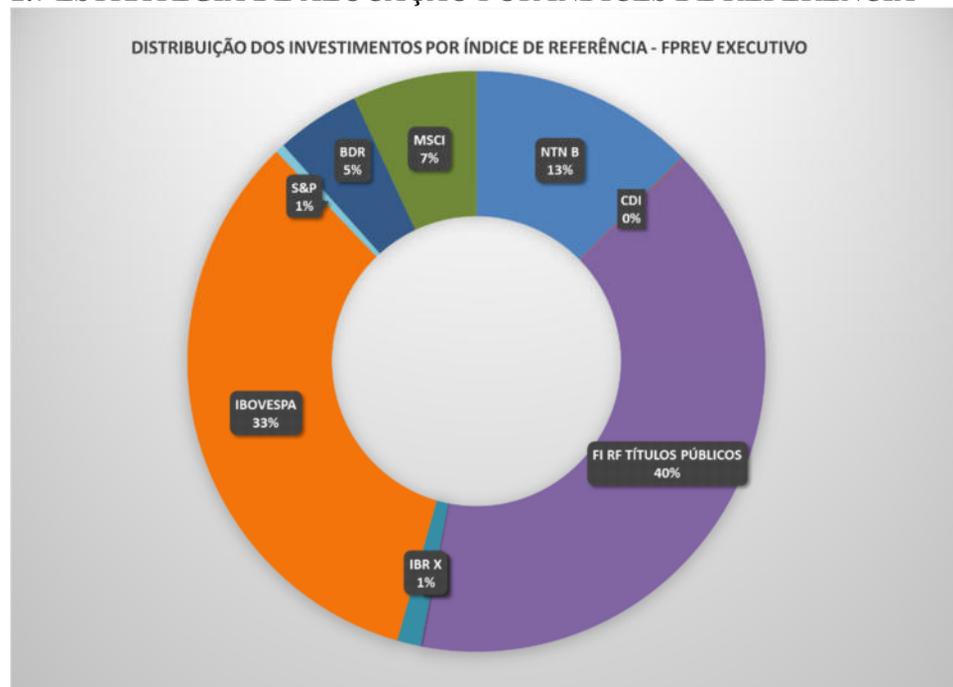


Gráfico 2.

2.8 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	31/03/2021	30/04/2021
CVS - A	R\$ 1.205.092,82	R\$ 1.187.639,50
CVS - B	R\$ 7.797.069,10	R\$ 7.684.091,30
CVS - C	R\$ 156.327,08	R\$ 154.063,00
CVS - D	R\$ 855.052,44	R\$ 842.662,92
TOTAL	R\$ 10.013.541,44	R\$ 9.868.456,72

Quadro 7.

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

2.9 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/21	R\$ 30.247,09	R\$ 145.084,72	R\$ 175.331,81
fev/21	R\$ 29.827,12	R\$ 145.084,72	R\$ 174.911,84
mar/21	R\$ 29.407,16	R\$ 145.084,72	R\$ 174.491,88
abr/21	R\$ 28.978,18	R\$ 145.084,72	R\$ 174.062,90
TOTAL	R\$ 118.459,55	R\$ 580.338,88	R\$ 698.798,43

Quadro 8.

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <http://www.portaldosegurado.am.gov.br:85/validar>
 e valide o código: NTE0MTE



2.10 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2021 (Contrato Regular)			
MÊS	UEA	SEAS	TOTAL
jan/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -
fev/21			R\$ -
mar/21		R\$ 100.364,40	R\$ 100.364,40
abr/21	R\$ 87.271,44	R\$ 100.364,40	R\$ 187.635,84
TOTAL	R\$ 87.271,44	R\$ 200.728,80	R\$ 288.000,24

Quadro 9.

2.11 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	31/03/2021	30/04/2021	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.007.489.236,14	R\$ 4.104.617.822,99	84,3056%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 684.729.539,73	R\$ 690.546.868,78	14,1833%
TÍTULOS CVS	R\$ 10.013.541,44	R\$ 9.868.456,72	0,2027%
IMÓVEIS	R\$ 61.835.325,18	R\$ 61.835.325,18	1,2700%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 1.867.128,60	0,0383%
TOTAL	R\$ 4.764.067.642,49	R\$ 4.868.735.602,27	100,00%

Quadro 10.

2.12 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
abr/20	R\$ 4.755.324.126,81	1,66%	-8,09%	9,55%
mai/20	R\$ 4.808.084.982,84	1,11%	-7,07%	8,26%
jun/20	R\$ 4.837.475.067,57	0,61%	-6,50%	6,07%
jul/20	R\$ 4.902.116.484,95	1,34%	-5,25%	5,41%
ago/20	R\$ 4.797.635.488,57	-2,13%	-7,27%	2,10%
set/20	R\$ 4.651.365.387,53	-3,05%	-10,10%	-3,39%
out/20	R\$ 4.549.328.612,79	-2,19%	-12,07%	-7,68%
nov/20	R\$ 4.700.643.285,36	3,33%	-9,15%	-5,39%
dez/20	R\$ 4.808.000.009,11	2,28%	-7,07%	-7,07%
jan/21	R\$ 4.691.638.612,35	-2,42%	-2,42%	-8,75%
fev/21	R\$ 4.654.824.437,71	-0,78%	-3,19%	-9,45%
mar/21	R\$ 4.764.067.642,49	2,35%	-0,91%	1,67%
abr/21	R\$ 4.868.735.602,27	2,20%	1,26%	2,42%

Quadro 11.



2.13 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

Saldo dos Investimentos em 04/2020		R\$ 4.755.324.126,81	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
05/2020	R\$ 40.614.112,23	R\$ 116.393.805,63	R\$ -75.779.693,40
06/2020	R\$ 32.820.094,52	R\$ 156.602.317,41	R\$ -123.782.222,89
07/2020	R\$ 33.058.400,54	R\$ 124.266.927,34	R\$ -91.208.526,80
08/2020	R\$ 39.455.936,02	R\$ 99.107.615,94	R\$ -59.651.679,92
09/2020	R\$ 39.934.090,22	R\$ 109.739.936,23	R\$ -69.805.846,01
10/2020	R\$ 38.961.921,68	R\$ 112.188.198,10	R\$ -73.226.276,42
11/2020	R\$ 39.697.646,11	R\$ 116.368.518,74	R\$ -76.670.872,63
12/2020	R\$ 117.527.713,10	R\$ 175.934.562,52	R\$ -58.406.849,42
01/2021	R\$ 584.279,15	R\$ 82.104.432,44	R\$ -81.520.153,29
02/2021	R\$ 40.864.605,59	R\$ 44.974.382,51	R\$ -4.109.776,92
03/2021	R\$ 41.485.170,47	R\$ 10.665.619,53	R\$ 30.819.550,94
04/2021	R\$ 41.308.639,76	R\$ 10.074.221,86	R\$ 31.234.417,90
Saldo dos Investimentos em 04/2021		R\$ 4.865.462.180,79	

1.2 Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	6,7592 %	2,3689 %	0,3100 %
Juros	5,4500 %	1,7846 %	0,4432 %
Meta	12,5776 %	4,1958 %	0,7546 %
Rentabilidade em %	17,5708 %	1,7051 %	1,4727 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 762.245.982,84	R\$ 81.038.133,05	R\$ 70.160.056,56
Resultado em %	+4,4353 %	-2,3903 %	+0,7127 %
Resultado em R\$	R\$ +216.979.689,73	R\$ -118.374.883,61	R\$ +34.211.552,27

Quadro 12.

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: Em decorrência da necessidade de revisão dos valores de Receita e Despesa durante o mês de maio/2021, alguns dados poderão ser atualizados nas tabelas de verificação da Rentabilidade.

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <http://www.portaldosegurado.am.gov.br:85/validar>
 e valide o código: NTE0MTE



3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/03/2021	30/04/2021	fev/21	mar/21	abr/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 5.177.583,30	R\$ 5.211.989,83	(0,2664)	0,3010	0,6645	0,6985%	0,7240%	4,8831%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 87.437,74	R\$ 87.531,67	0,0032	0,1400	0,1100	0,2533%	0,3983%	1,9721%
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 1.944.929,98	R\$ 1.968.874,40	(0,5264)	0,3300	1,2300	1,0294%	1,3659%	11,6785%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 204.952,54	R\$ 351.455,30	-	0,3700	0,8398	1,2129%	1,2129%	NC
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 7.414.903,56	R\$ 7.619.851,20						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/03/2021	30/04/2021	fev/21	mar/21	abr/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 524.888,51	R\$ 533.652,26	(3,8100)	5,0600	1,6700	2,7449%	4,4603%	35,0923%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 1.585.736,61	R\$ 1.601.504,99	(2,5279)	1,7256	0,9943	0,1400%	-0,4765%	NC
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 490.239,64	R\$ 493.998,71	(5,3612)	2,1311	0,7668	-2,6032%	-3,9420%	27,1753%
OCCAM FIC FIA	R\$ 2.085.171,45	R\$ 2.158.418,94	(3,3629)	3,9351	3,5100	3,9653%	0,7112%	47,8499%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 4.686.036,21	R\$ 4.787.574,90						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/03/2021	30/04/2021	fev/21	mar/21	abr/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 1.416.979,15	R\$ 1.454.785,86	4,4700	3,0300	2,6681	10,5073%	14,6513%	35,2391%
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.416.979,15	R\$ 1.454.785,86						

TOTAL GERAL	R\$ 13.517.918,92	R\$ 13.862.211,96						
--------------------	--------------------------	--------------------------	--	--	--	--	--	--

Quadro 13.

Nota: Com base na Ata 172/2020, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Direcionar para o Fundo BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2.

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/03/2021	30/04/2021	fev/21	mar/21	abr/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.311.493,09	R\$ 2.331.587,07	1,422374	1,492764	0,869307	3,8312%	4,6467%	13,8852%
TOTAL GERAL	R\$ 2.311.493,09	R\$ 2.331.587,07						

Quadro 14.

3.3 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	31/03/2021	30/04/2021
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 7.414.903,56	R\$ 7.619.851,20
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 4.686.036,21	R\$ 4.787.574,90
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.416.979,15	R\$ 1.454.785,86
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.311.493,09	R\$ 2.331.587,07
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 15.829.412,01	R\$ 16.193.799,03

Quadro 15.

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <http://www.portaldosegurado.am.gov.br:85/validar>
e valide o código: NTE0MTE



3.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

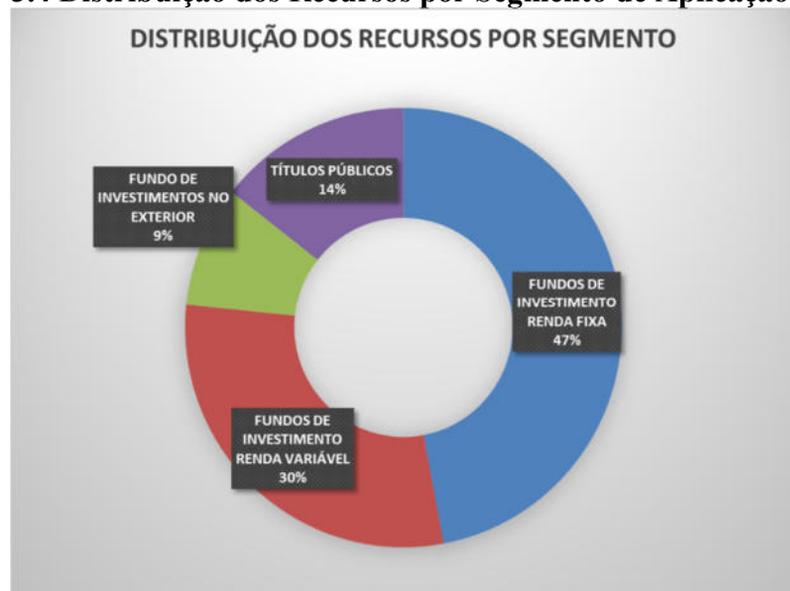


Gráfico 3.

3.5 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

Saldo dos Investimentos em 04/2020		R\$ 12.933.067,87	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
05/2020	R\$ 119.498,47	R\$ 0,00	R\$ 119.498,47
06/2020	R\$ 118.639,37	R\$ 0,00	R\$ 118.639,37
07/2020	R\$ 118.639,37	R\$ 0,00	R\$ 118.639,37
08/2020	R\$ 154.104,87	R\$ 0,00	R\$ 154.104,87
09/2020	R\$ 170.237,76	R\$ 0,00	R\$ 170.237,76
10/2020	R\$ 143.453,76	R\$ 0,00	R\$ 143.453,76
11/2020	R\$ 143.747,84	R\$ 0,00	R\$ 143.747,84
12/2020	R\$ 133.342,71	R\$ 0,00	R\$ 133.342,71
01/2021	R\$ 286.790,86	R\$ 0,00	R\$ 286.790,86
02/2021	R\$ 143.097,24	R\$ 0,00	R\$ 143.097,24
03/2021	R\$ 143.973,76	R\$ 0,00	R\$ 143.973,76
04/2021	R\$ 144.001,52	R\$ 0,00	R\$ 144.001,52
Saldo dos Investimentos em 04/2021		R\$ 16.193.799,03	

1.2 Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	6,7592 %	2,3689 %	0,3100 %
Juros	5,4500 %	1,7846 %	0,4432 %
Meta	12,5776 %	4,1958 %	0,7546 %
Rentabilidade em %	10,5192 %	1,9953 %	1,3923 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 1.441.203,63	R\$ 309.034,06	R\$ 220.385,50
Resultado em %	-1,8284 %	-2,1119 %	+0,6329 %
Resultado em R\$	R\$ -281.653,12	R\$ -340.769,04	R\$ +100.940,58

Quadro 16.

Nota: Em decorrência da necessidade de revisão dos valores de Receita e Despesa durante o mês de maio/2021, alguns dados poderão ser atualizados nas tabelas de verificação da Rentabilidade.

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <http://www.portalidosegurado.am.gov.br:85/validar>
 e valide o código: NTE0MTE



4. RECURSOS DO MPE – FPREV

4.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/03/2021	30/04/2021	fev/21	mar/21	abr/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 7.673.614,98	R\$ 7.724.608,30	(0,5075)	0,3010	0,6645	0,4551%	0,4805%	NC	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 39.954.368,64	R\$ 40.157.613,96	(0,9579)	(0,5400)	0,5300	-0,9706%	-1,5450%	3,3504%	
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 77.529.182,14	R\$ 78.010.997,47	(0,9139)	(0,4211)	0,6214	-0,7180%	-1,2664%	4,0452%	
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 1.552.991,24	R\$ 3.169.421,95	-	0,3700	0,8398	1,2129%	1,2129%	NC	
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 126.710.157,00	R\$ 129.062.641,68							

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/03/2021	30/04/2021	fev/21	mar/21	abr/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 25.038.257,90	R\$ 25.837.283,77	(3,0870)	4,0800	3,1900	4,0847%	0,6395%	NC	
BB AÇÕES VALOR	R\$ 21.480.287,57	R\$ 21.979.445,79	-	8,6306	2,3237	11,1548%	11,1548%	NC	
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 46.518.545,47	R\$ 47.816.729,56							

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1.934,84	R\$ 1.642,15
TOTAL RECURSOS	R\$ 173.230.637,31	R\$ 176.881.013,39

Quadro 17.

Nota: Com base na Ata 172/2020, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Direcionar para o Fundo BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
Saldo dos Investimentos em 04/2020			R\$ 148.571.836,20
05/2020	R\$ 1.482.380,96	R\$ 0,00	R\$ 1.482.380,96
06/2020	R\$ 1.273.507,14	R\$ 10.584,16	R\$ 1.262.922,98
07/2020	R\$ 1.272.066,06	R\$ 11.829,88	R\$ 1.260.236,18
08/2020	R\$ 1.482.857,02	R\$ 9.164,74	R\$ 1.473.692,28
09/2020	R\$ 1.514.681,38	R\$ 7.663,69	R\$ 1.507.017,69
10/2020	R\$ 1.490.094,20	R\$ 9.164,74	R\$ 1.480.929,46
11/2020	R\$ 1.503.550,04	R\$ 9.164,74	R\$ 1.494.385,30
12/2020	R\$ 1.579.792,66	R\$ 12.799,56	R\$ 1.566.993,10
01/2021	R\$ 3.008.450,20	R\$ 8.065,16	R\$ 3.000.385,04
02/2021	R\$ 1.585.217,06	R\$ 9.707,31	R\$ 1.575.509,75
03/2021	R\$ 1.564.682,30	R\$ 8.065,16	R\$ 1.556.617,14
04/2021	R\$ 1.594.346,58	R\$ 9.707,31	R\$ 1.584.639,27
Saldo dos Investimentos em 04/2021			R\$ 176.881.013,39

1.2 Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Item	Em 12 meses	No ano	No mês
Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
IPCA	6,7592 %	2,3689 %	0,3100 %
Juros	5,4500 %	1,7846 %	0,4432 %
Meta	12,5776 %	4,1958 %	0,7546 %
Rentabilidade em %	5,7829 %	-0,0454 %	1,1925 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 9.063.468,04	R\$ -78.348,91	R\$ 2.065.736,81
Resultado em %	-6,0355 %	-4,0704 %	+0,4346 %
Resultado em R\$	R\$ -10.636.569,05	R\$ -7.322.064,42	R\$ +758.580,26

Quadro 18.



Nota: Em decorrência da necessidade de revisão dos valores de Receita e Despesa durante o mês de maio/2021, alguns dados poderão ser atualizados nas tabelas de verificação da Rentabilidade.

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/03/2021	30/04/2021	fev/21	mar/21	abr/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 15.791,59	R\$ 15.912,68	-	2,1311	0,7668	2,9142%	2,9142%	NC
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGIA	R\$ 7.831.760,37	R\$ 7.883.804,61	(0,5075)	0,3010	0,6645	0,4551%	0,4805%	NC
BRADESCO INST. ALOC. DINAMICA	R\$ 8.476.337,56	R\$ 8.521.512,62	(0,9579)	(0,5400)	0,5300	-0,9706%	-1,5450%	5,0558%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 9.555.492,29	R\$ 9.594.128,77	(0,7911)	0,0900	0,9400	0,2316%	0,2115%	6,3707%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 995.002,31	R\$ 2.017.650,25	-	0,3700	0,8398	1,2129%	1,2129%	0,3700%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 12.536,46	R\$ 18.285,14						
TOTAL	R\$ 26.886.920,58	R\$ 28.051.294,07						

Quadro 19.

Nota: Com base na Ata 172/2020, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Direcionar para o Fundo BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2

5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV

Saldo dos Investimentos em 04/2020		R\$ 14.889.701,24	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
05/2020	R\$ 954.963,10	R\$ 0,00	R\$ 954.963,10
06/2020	R\$ 808.818,93	R\$ 0,00	R\$ 808.818,93
07/2020	R\$ 809.559,37	R\$ 0,00	R\$ 809.559,37
08/2020	R\$ 951.659,78	R\$ 0,00	R\$ 951.659,78
09/2020	R\$ 950.378,64	R\$ 0,00	R\$ 950.378,64
10/2020	R\$ 952.657,42	R\$ 0,00	R\$ 952.657,42
11/2020	R\$ 969.890,42	R\$ 19.728,47	R\$ 950.161,95
12/2020	R\$ 2.981.491,21	R\$ 92.070,31	R\$ 2.889.420,90
01/2021	R\$ 6.283,41	R\$ 77.294,71	R\$ -71.011,30
02/2021	R\$ 1.003.038,47	R\$ 51.465,27	R\$ 951.573,20
03/2021	R\$ 992.747,96	R\$ 51.465,27	R\$ 941.282,69
04/2021	R\$ 999.548,81	R\$ 39.463,54	R\$ 960.085,27
Saldo dos Investimentos em 04/2021		R\$ 28.051.294,07	

1.2 Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	6,7592 %	2,3689 %	0,3100 %
Juros	5,4500 %	1,7846 %	0,4432 %
Meta	12,5776 %	4,1958 %	0,7546 %
Rentabilidade em %	5,4959 %	-0,2257 %	0,7598 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 1.112.042,88	R\$ -58.649,48	R\$ 204.288,22
Resultado em %	-6,2905 %	-4,2434 %	+0,0052 %
Resultado em R\$	R\$ -1.424.419,80	R\$ -1.148.608,45	R\$ +1.406,01

Quadro 20.

Nota: Em decorrência da necessidade de revisão dos valores de Receita e Despesa durante o mês de maio/2021, alguns dados poderão ser atualizados nas tabelas de verificação da Rentabilidade.



6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/03/2021	30/04/2021	fev/21	mar/21	abr/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 163.834.238,69	R\$ 164.922.963,23	(0,5075)	0,3010	0,6645	0,4551%	0,4805%	NC
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 50.831.496,38	R\$ 51.147.395,42	(0,9139)	(0,4211)	0,6214	-0,7180%	-1,2664%	NC
BB PREV RF IDKA 2	R\$ 163.672.954,07	R\$ 165.069.690,65	(0,5482)	0,3700	0,8398	0,6581%	0,8361%	NC
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 42.145.960,64	R\$ 42.225.861,55	(0,7911)	0,0900	0,9400	0,2316%	0,2115%	8,8695%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 420.484.649,78	R\$ 423.365.910,85						
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/03/2021	30/04/2021	fev/21	mar/21	abr/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 9.948.517,77	R\$ 10.024.801,05	(5,3612)	2,1311	0,7668	-2,6032%	-3,9420%	NC
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 4.783.100,47	R\$ 4.935.739,72	(3,0872)	4,0800	3,1900	4,0845%	0,6393%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 14.731.618,24	R\$ 14.960.540,77						
FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/03/2021	30/04/2021	fev/21	mar/21	abr/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 24.006.655,31	R\$ 24.242.256,28	-	3,8559	0,9813	4,8750%	4,8750%	NC
TOTAL - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 24.006.655,31	R\$ 24.242.256,28						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 31.064,68	R\$ 3.604.104,50						
TOTAL	R\$ 459.253.988,01	R\$ 466.172.812,40						

Quadro 21.

Nota: Com base na Ata 172/2020, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Direcionar para o Fundo BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2

6.2 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

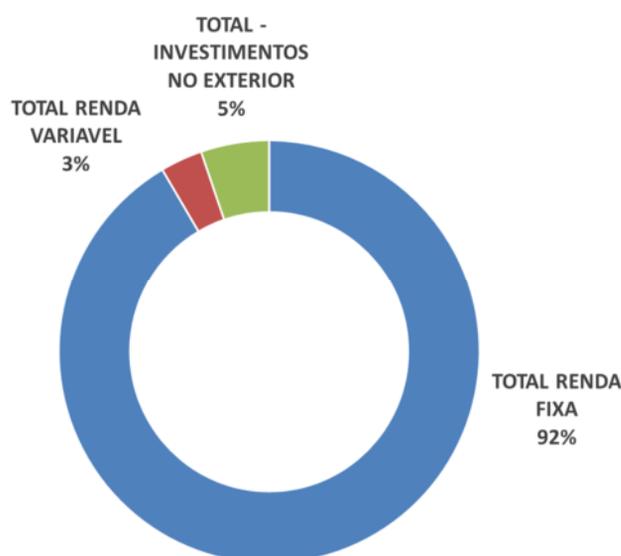


Gráfico 4.



6.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV

Saldo dos Investimentos em 04/2020		R\$ 32.046.672,56	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
05/2020	R\$ 5.222.844,03	R\$ 280.083,57	R\$ 4.942.760,46
06/2020	R\$ 2.652.044,89	R\$ 345.842,60	R\$ 2.306.202,29
07/2020	R\$ 3.093.956,95	R\$ 155.165,84	R\$ 2.938.791,11
08/2020	R\$ 3.115.630,27	R\$ 491.741,78	R\$ 2.623.888,49
09/2020	R\$ 381.166.785,90	R\$ 305.986,37	R\$ 380.860.799,53
10/2020	R\$ 3.325.215,77	R\$ 305.986,37	R\$ 3.019.229,40
11/2020	R\$ 3.555.836,55	R\$ 303.719,14	R\$ 3.252.117,41
12/2020	R\$ 6.779.546,58	R\$ 408.928,65	R\$ 6.370.617,93
01/2021	R\$ 3.459.800,94	R\$ 280.567,30	R\$ 3.179.233,64
02/2021	R\$ 3.471.253,44	R\$ 314.749,25	R\$ 3.156.504,19
03/2021	R\$ 3.427.904,40	R\$ 367.719,45	R\$ 3.060.184,95
04/2021	R\$ 3.574.036,92	R\$ 317.977,95	R\$ 3.256.058,97
Saldo dos Investimentos em 04/2021		R\$ 466.172.812,40	

1.2 Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	6,7592 %	2,3689 %	0,3100 %
Juros	5,4500 %	1,7846 %	0,4432 %
Meta	12,5776 %	4,1958 %	0,7546 %
Rentabilidade em %	5,6466 %	0,4361 %	0,7975 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 15.159.751,47	R\$ 1.989.498,45	R\$ 3.662.765,42
Resultado em %	-6,1566 %	-3,6083 %	+0,0426 %
Resultado em R\$	R\$ -18.211.940,56	R\$ -17.152.343,75	R\$ +197.345,75

Quadro 22.

Nota: Em decorrência da necessidade de revisão dos valores de Receita e Despesa durante o mês de maio/2021, alguns dados poderão ser atualizados nas tabelas de verificação da Rentabilidade.

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <http://www.portaldosegurado.am.gov.br:85/validar>
 e valide o código: NTE0MTE



7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/03/2021	30/04/2021	fev/21	mar/21	abr/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 41.987.769,50	R\$ 42.266.790,03	(0,5075)	0,3010	0,6645	0,4551%	0,4805%	NC
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 30.616.359,15	R\$ 30.873.500,00	(0,5482)	0,3700	0,8398	0,6581%	0,8361%	NC
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 21.105.811,69	R\$ 21.236.976,54	(0,9139)	(0,4211)	0,6214	-0,7180%	-1,2664%	NC
BRDESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 7.522.768,66	R\$ 7.593.658,11	(0,7911)	0,0900	0,9400	0,2316%	0,2115%	8,1259%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 101.232.709,00	R\$ 101.970.924,68						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/03/2021	30/04/2021	fev/21	mar/21	abr/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 9.948.517,77	R\$ 10.024.801,05	(5,3612)	2,1311	0,7668	-2,6032%	-3,9420%	NC
BRDESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 508.690,73	R\$ 524.924,17	-	4,0800	3,1900	7,4002%	7,4002%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 10.457.208,50	R\$ 10.549.725,22						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/03/2021	30/04/2021	fev/21	mar/21	abr/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 528.980,21	R\$ 534.171,61	-	3,8559	0,9813	4,8750%	4,8750%	NC
TOTAL - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 528.980,21	R\$ 534.171,61						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1.007,93	R\$ 5.972,63						
TOTAL	R\$ 112.219.905,64	R\$ 113.060.794,14						

Quadro 23.

Nota: Com base na Ata 172/2020, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Direcionar para o Fundo BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2

7.2 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR SEGMENTO

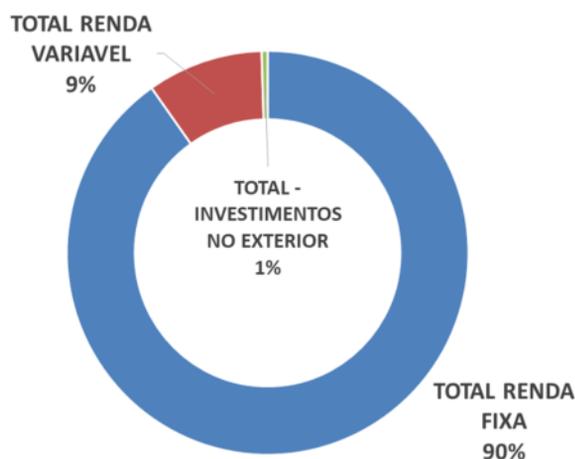


Gráfico 5.

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <http://www.portaldossegurado.am.gov.br:85/validar>
e valide o código: NTE0MTE



7.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV

Saldo dos Investimentos em 04/2020		R\$ 5.650.926,46	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
05/2020	R\$ 446.927,24	R\$ 0,00	R\$ 446.927,24
06/2020	R\$ 447.429,30	R\$ 0,00	R\$ 447.429,30
07/2020	R\$ 522.267,78	R\$ 0,00	R\$ 522.267,78
08/2020	R\$ 522.585,60	R\$ 0,00	R\$ 522.585,60
09/2020	R\$ 99.120.333,45	R\$ 0,00	R\$ 99.120.333,45
10/2020	R\$ 521.775,18	R\$ 0,00	R\$ 521.775,18
11/2020	R\$ 1.032.124,86	R\$ 0,00	R\$ 1.032.124,86
12/2020	R\$ 521.263,88	R\$ 0,00	R\$ 521.263,88
01/2021	R\$ 7.943,52	R\$ 0,00	R\$ 7.943,52
02/2021	R\$ 1.040.178,80	R\$ 0,00	R\$ 1.040.178,80
03/2021	R\$ 523.658,87	R\$ 0,00	R\$ 523.658,87
04/2021	R\$ 4.964,70	R\$ 0,00	R\$ 4.964,70
Saldo dos Investimentos em 04/2021		R\$ 113.060.794,14	

1.2 Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	6,7592 %	2,3689 %	0,3100 %
Juros	5,4500 %	1,7846 %	0,4432 %
Meta	12,5776 %	4,1958 %	0,7546 %
Rentabilidade em %	4,1152 %	-0,3533 %	0,7449 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 2.698.414,50	R\$ -397.614,59	R\$ 835.923,80
Resultado em %	-7,5169 %	-4,3659 %	-0,0096 %
Resultado em R\$	R\$ -5.425.091,19	R\$ -5.119.154,43	R\$ -10.860,50

Quadro 24.

Nota: Em decorrência da necessidade de revisão dos valores de Receita e Despesa durante o mês de maio/2021, alguns dados poderão ser atualizados nas tabelas de verificação da Rentabilidade.

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <http://www.portaldossegurado.am.gov.br:85/validar>
 e valide o código: NTE0MTE



8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV

Saldo dos Investimentos em 04/2020		R\$ 4.969.416.331,14	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
05/2020	R\$ 48.840.726,03	R\$ 116.673.889,20	R\$ -67.833.163,17
06/2020	R\$ 38.120.534,15	R\$ 156.958.744,17	R\$ -118.838.210,02
07/2020	R\$ 38.874.890,07	R\$ 124.433.923,06	R\$ -85.559.032,99
08/2020	R\$ 45.682.773,56	R\$ 99.608.522,46	R\$ -53.925.748,90
09/2020	R\$ 522.856.507,35	R\$ 110.053.586,29	R\$ 412.802.921,06
10/2020	R\$ 45.395.118,01	R\$ 112.503.349,21	R\$ -67.108.231,20
11/2020	R\$ 46.902.795,82	R\$ 116.701.131,09	R\$ -69.798.335,27
12/2020	R\$ 129.523.150,14	R\$ 176.448.361,04	R\$ -46.925.210,90
01/2021	R\$ 7.353.548,08	R\$ 82.470.359,61	R\$ -75.116.811,53
02/2021	R\$ 48.107.390,60	R\$ 45.350.304,34	R\$ 2.757.086,26
03/2021	R\$ 48.138.137,76	R\$ 11.092.869,41	R\$ 37.045.268,35
04/2021	R\$ 47.625.538,29	R\$ 10.441.370,66	R\$ 37.184.167,63
Saldo dos Investimentos em 04/2021		R\$ 5.665.821.893,82	

1.2 Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	6,7592 %	2,3689 %	0,3100 %
Juros	5,4500 %	1,7846 %	0,4432 %
Meta	12,5776 %	4,1958 %	0,7546 %
Rentabilidade em %	16,3049 %	1,4958 %	1,3897 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 791.720.863,36	R\$ 82.802.052,58	R\$ 77.149.156,31
Resultado em %	+3,3109 %	-2,5912 %	+0,6304 %
Resultado em R\$	R\$ +181.000.016,01	R\$ -149.457.823,70	R\$ +35.258.964,37

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: Em decorrência da necessidade de revisão dos valores de Receita e Despesa durante o mês de maio/2021, alguns dados poderão ser atualizados nas tabelas de verificação da Rentabilidade.

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <http://www.portaldosegurado.am.gov.br:85/validar>
 e valide o código: NTE0MTE





Gráfico 6.

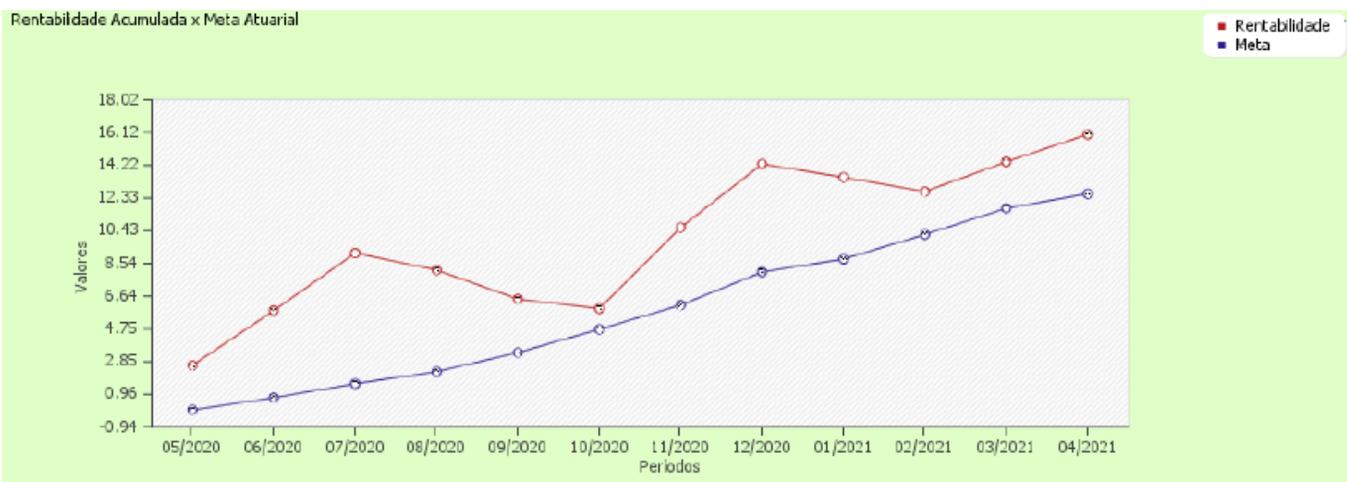


Gráfico 7.

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <http://www.portaldosegurado.am.gov.br:85/validar>
 e valide o código: NTE0MTE



9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN**9.1 FFIN – Poder Executivo**

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	26/02/2021	31/03/2021
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.615.012,89	R\$ 1.042.764,11
FUNDO BRADESCO FIC FI RF ALOC. DINÂMICA - COMPREV	R\$ 5.340.829,83	R\$ 5.311.882,74
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 0,02	R\$ 0,02
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 13.695.820,07	R\$ 13.167.550,94
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 223.433,51	R\$ 255.107,37
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 20.875.097,32	R\$ 19.777.306,18

Quadro 26.

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

9.2 Fundo Previdenciário Militares

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	26/02/2021	31/03/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R\$ 8.036,85	R\$ 4.847,83
BRADESCO DI PREMIUM - FPPM	R\$ -	R\$ 8.628,4600
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R\$ 1,00	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ 10.005,15	R\$ 9.948,20
TOTAL	R\$ 18.043,00	R\$ 23.424,49

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.

9.3 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/03/2021	30/04/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 25,36
TOTAL	R\$ -	R\$ 25,36

Quadro 28.

9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/03/2021	30/04/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 406.020,94	R\$ 409.014,46
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 47.560,37	R\$ 93.123,14
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ -
TOTAL	R\$ 453.582,31	R\$ 502.137,60

Quadro 29.

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <http://www.portalidosegurado.am.gov.br:85/validar>
 e valide o código: NTE0MTE



9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/03/2021	30/04/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 723.851,78	R\$ 1.132.235,53
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ 216.274,13	R\$ 432.893,82
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 940.125,91	R\$ 1.565.129,35

Quadro 30.

9.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/03/2021	30/04/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 6.016.225,14	R\$ 1.070.337,86
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	R\$ 527.583,59	R\$ 1.073.984,96
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 5.062.814,81
TOTAL	R\$ 6.543.808,73	R\$ 7.207.137,63

Quadro 31.

9.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/03/2021	30/04/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.209.393,95	R\$ 81.628,55
DISPONIBILIDADE COBERTURA TCE FFIN	R\$ 987.282,05	R\$ 994.306,06
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 231,16	R\$ -
TOTAL	R\$ 2.196.907,16	R\$ 1.075.934,61

Quadro 32.

10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO**10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO**

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/03/2021	30/04/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.572.819,48	R\$ 705.803,46
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 48.984.904,19	R\$ 49.310.422,64
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 50.557.724,67	R\$ 50.016.227,10

Quadro 33.

10.2 Taxa de Administração - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/03/2021	30/04/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 433.046,49	R\$ 470.143,79
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 433.046,49	R\$ 470.143,79

Quadro 34.

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
 Acesso: <http://www.portaldosegurado.am.gov.br:85/validar>
 e valide o código: NTE0MTE



10.3 Taxa de Administração - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/03/2021	30/04/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 218.530,78	R\$ 282.149,67
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 218.530,78	R\$ 282.149,67

Quadro 35.

10.4 Taxa de Administração – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/03/2021	30/04/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.328.501,77	R\$ 1.526.272,75
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 1.328.501,77	R\$ 1.526.272,75

Quadro 36.

10.5 Taxa de Administração – PGJ/MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/03/2021	30/04/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ 575.002,36
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ -	R\$ 575.002,36

TOTAL GERAL	R\$ 52.537.803,71	R\$ 52.869.795,67
--------------------	--------------------------	--------------------------

Quadro 37.

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <http://www.portaldosegurado.am.gov.br:85/validar>
 e valide o código: NTE0MTE



11. ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS

11.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2021		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
TÍTULOS DO TN	RS 692.878.455,85	12,26%	10,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
TOTAL art. 7º, inciso I, "a"	RS 692.878.455,85				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	RS 6.945.557,64	35,56%	22,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	RS 458.395.967,93				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	RS 484.524.336,27				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	RS 53.379.206,77				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	RS 808.489.627,96				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	RS 109.469.933,64				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	RS 60.597.964,35				
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	RS 28.680.250,82				
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	RS 2.010.482.845,38				
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	RS 11.113.468,68	10,62%	13,00%	40,00%	art. 7º, inciso IV, "a"
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	RS 2.162,62				
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	RS 59.413.648,43				
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	RS 54.019.319,22				
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	RS 475.508.203,00				
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	RS 108.700,94				
TOTAL art. 7º, inciso IV, "a"	RS 600.165.502,89				
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	RS 30.162.395,91	0,53%	3,00%	5,00%	art. 7º, inciso VII, "b"
TOTAL art. 7º, inciso VII, "b"	RS 30.162.395,91				
TOTAL RENDA FIXA	RS 3.333.689.200,03	58,96%			

Quadro 38.

11.2 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Variável

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2021		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	RS 92.996.081,47	1,64%	3,00%	30,00%	art. 8º, inciso I, "a"
TOTAL art. 8º, inciso I, "a"	RS 92.996.081,47				
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	RS 41.031.880,04	28,56%	30,00%	30,00%	art. 8º, inciso II, "a"
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	RS 176.326.547,56				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	RS 155.545.582,61				
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	RS 63.471.772,14				
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	RS 65.631.685,83				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	RS 179.936.971,66				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	RS 91.901.452,76				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	RS 181.896.272,54				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	RS 334.039.484,26				
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	RS -				
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO 30	RS 46.766.080,07				
SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	RS 14.863,70				
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	RS 90.230.730,64				
OCCAM FIC FIA	RS 135.177.418,55				
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	RS 32.866.562,83				
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	RS 9.878.845,32				
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	RS 9.811.239,07				
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	RS 10.113.585,56				
TOTAL art. 8º, inciso II, "a"	RS 1.624.640.975,14				
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	RS 24.325.680,39	0,43%	3,00%	3,00%	art. 8º, inciso III
TOTAL art. 8º, inciso III	RS 24.325.680,39				
BTG ECONOMIA REAL FIP	RS 6.745.596,57	0,12%	2,00%	5,00%	art. 8º, inciso IV, "a"
TOTAL art. 8º, inciso IV, "a"	RS 6.745.596,57				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	RS 1.748.708.333,57	30,75%			

Quadro 39.

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesso: <http://www.portalidosegurado.am.gov.br:85/validar>
e valide o código: NTE0MTE



11.3 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Investimentos no Exterior

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 108.241.663,54	6,19%	5,00%	10,00%	art 9º-A, inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXTERIOR	R\$ 142.851.062,63				
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 28.983.588,91				
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 35.564.693,59				
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 34.300.753,66				
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 349.941.762,33				
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	R\$ 80.255.295,41	3,92%	5,00%		art 9º-A, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NÍVEL I	R\$ 141.245.655,39				
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 221.500.950,80				
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 571.442.713,13	10,11%			
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 5.653.840.246,73				

Quadro 40.

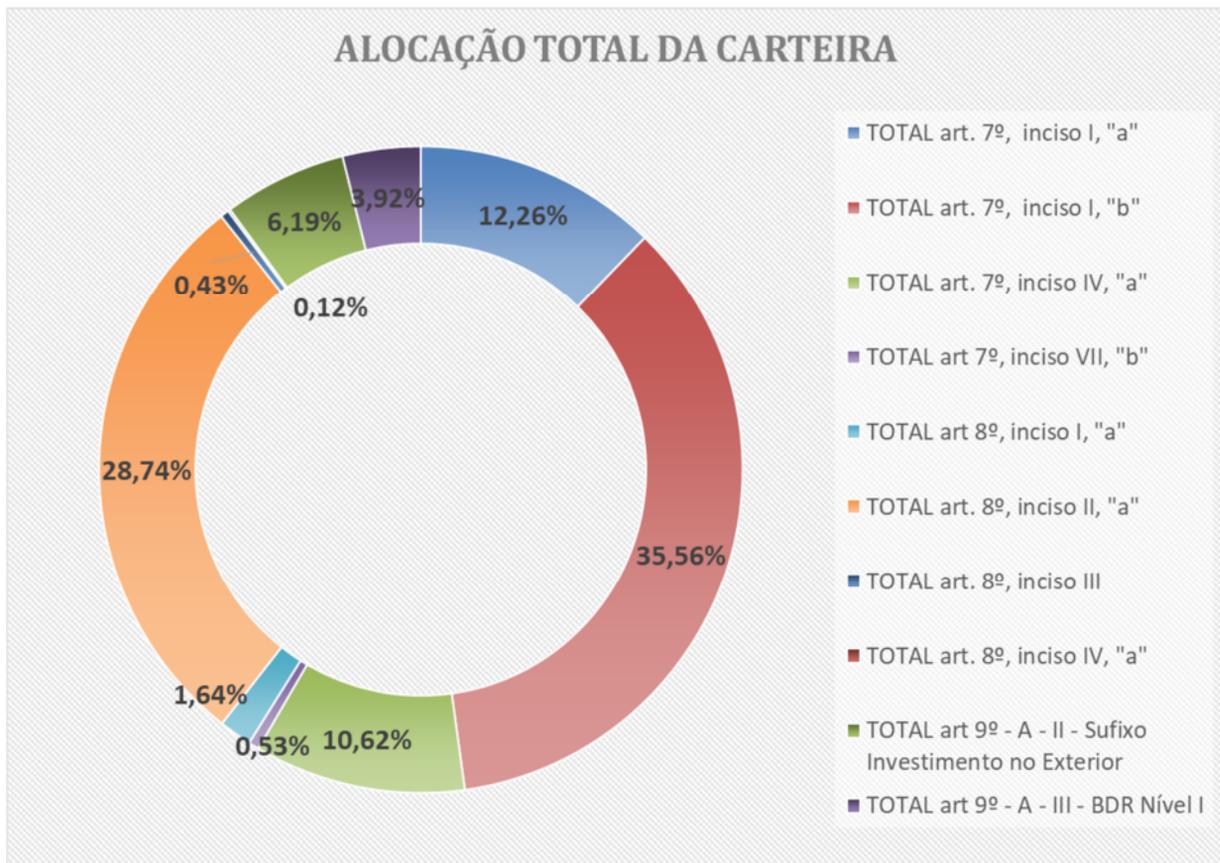


Gráfico 8.

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <http://www.portaldossegurado.am.gov.br:85/validar>
 e valide o código: NTE0MTE



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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% CARTEIRA	Resolução CMN n° 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 6.945.557,64	0,12%	20%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 458.395.967,93	7,96%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 475.508.203,00	8,26%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 155.545.582,61	2,70%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 80.255.295,41	1,39%	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 108.241.663,54	1,88%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 484.524.336,27	8,42%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 53.379.206,77	0,93%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 11.113.468,68	0,19%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 2.162,62	0,00%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 59.413.648,43	1,03%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 54.019.319,22	0,94%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 92.996.081,47	1,62%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 176.326.547,56	3,06%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 108.700,94	0,00%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 808.489.627,96	14,05%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 41.031.880,04	0,71%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 179.936.971,66	3,13%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 91.901.452,76	1,60%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 63.471.772,14	1,10%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 65.631.685,83	1,14%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 181.896.272,54	3,16%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 30.162.395,91	0,52%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 109.469.933,64	1,90%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 60.597.964,35	1,05%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 334.039.484,26	5,80%	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 6.745.596,57	0,12%	
SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 14.863,70	0,00%	
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$ 46.766.080,07	0,81%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 142.851.062,63	2,48%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 10.113.585,56	0,18%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 24.325.680,39	0,42%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 28.680.250,82	0,50%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 141.245.655,39	2,45%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 90.230.730,64	1,57%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 135.177.418,55	2,35%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 32.866.562,83	0,57%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 9.811.239,07	0,17%	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 35.564.693,59	0,62%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 34.300.753,66	0,60%	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 9.878.845,32	0,17%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 28.983.588,91	0,50%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO	R\$ 4.960.961.790,88		

Quadro 41.

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



11.5 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 TP VII - 15/08/2022	R\$ 6.917.542,68	19.523.305/0001-06	R\$ 240.972.949,54	2,87%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 439.540.945,99	13.322.205/0001-35	R\$ 8.957.703.037,59	4,91%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 472.571.346,02	25.078.994/0001-90	R\$ 9.507.617.903,00	4,97%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 152.013.106,97	29.258.294/0001-38	R\$ 1.177.292.184,55	12,91%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 79.949.515,64	21.470.644/0001-13	R\$ 1.208.962.567,14	6,61%	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 107.189.705,31	17.413.636/0001-68	R\$ 1.785.873.756,52	6,00%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 16.766.815,43	08.246.263/0001-97	R\$ 397.338.580,93	4,22%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 8.629,63	03.399.411/0001-90	R\$ 3.219.925.406,69	0,00%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 59.224.221,59	20.216.216.0001/04	R\$ 1.065.355.221,87	5,56%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 53.742.588,94	28.515.874/0001-09	R\$ 1.406.629.483,62	3,82%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 90.120.149,34	14.099.976/0001-78	R\$ 586.704.302,13	15,36%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 168.990.880,35	06.988.623/0001-09	R\$ 2.141.846.289,54	7,89%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 480.385.103,60	11.060.913/0001-10	R\$ 13.551.415.614,91	3,54%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 52.598.778,27	22.791.074/0001-26	R\$ 214.654.568,75	24,50%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 803.152.454,23	23.215.097/0001-55	R\$ 15.491.489.347,05	5,18%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 82.564.093,76	10.577.512/0001-79	R\$ 630.846.852,38	13,09%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 108.584,29	21.838.150/0001-49	R\$ 3.580.849.195,10	0,00%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 39.901.426,98	08.817.414/0001-10	R\$ 981.481.248,05	4,07%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 62.960.380,35	23.731.629/0001-07	R\$ 1.088.808.596,09	5,78%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 174.167.462,84	24.571.992/0001-75	R\$ 3.385.715.282,16	5,14%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 86.364.720,04	01.063.897/0001-65	R\$ 1.354.225.128,44	6,38%	
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO 30	R\$ 45.988.315,18	29.549.642/0001-26	R\$ 1.453.995.731,90	3,16%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 15.337,20	02.436.763/0001-05	R\$ 432.011.131,47	0,00%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ -	01.699.688/0001-02	R\$ 566.151.716,74	0,00%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 141.372.070,13	17.804.792/0001-50	R\$ 1.656.051.100,50	8,54%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 178.909.134,80	08.279.304/0001-41	R\$ 1.494.264.626,94	11,97%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 108.518.916,55	10.922.432/0001-03	R\$ 921.256.811,75	11,78%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 60.340.348,32	10.756.541/0001-06	R\$ 795.575.669,42	7,58%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 28.510.074,44	30.659.168/0001-74	R\$ 1.525.094.042,58	1,87%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 330.750.540,19	11.977.794/0001-64	R\$ 2.831.568.584,73	11,68%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 137.574.989,20	19.436.818/0001-80	R\$ 2.654.448.171,68	5,18%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 84.376.765,95	34.791.108/0001-61	R\$ 2.040.029.723,44	4,14%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 130.590.076,25	11.628.883/0001-03	R\$ 1.109.023.441,48	11,78%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 32.217.327,79	11.458.144/0001-02	R\$ 810.805.346,86	3,97%	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 20.971.787,48	37.331.285/0001-53	R\$ 109.238.423.934,79	0,02%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 20.289.668,37	37.331.299/0001-77	R\$ 39.085.800.370,31	0,05%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 9.803.850,19	09.290.813/0001-38	R\$ 114.173.453,98	8,59%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 40.682.977,71	37.308.394/0001-50	R\$ 9.139.087.088,52	0,45%	
TOTAL	R\$ 4.800.150.632,00				

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\$ 23.088.119,79	21.595.829/0001-54	R\$ 1.037.182.533,83	2,23%	5%
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 6.779.153,09	35.640.811/0001-31	R\$ 485.987.734,85	1,39%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 29.795.576,64	19.719.727/0001-51	R\$ 914.587.003,20	3,26%	
TOTAL	R\$ 59.662.849,52				

TOTAL	R\$ 4.859.813.481,52
--------------	-----------------------------

Quadro 42.

Documento assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
Documento assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
Documento assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
Documento assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <http://www.portalidosegurado.am.gov.br:85/validar>
e valide o código: NTE0MTE



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);

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. Nesse caso, registra-se o fundo Bradesco IBRX Alpha (14.099.976/0001-78);

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;

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA MARÇO/2021) EM R\$ MI	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (ABRIL/2021)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
CAIXA	R\$ 419.083,11	R\$ 1.409.864.943,14	0,3364%	5%
BB DTVM S.A	R\$ 1.219.060,22	R\$ 1.284.892.270,13	0,1054%	
BRDESCO	R\$ 533.183,64	R\$ 393.871.227,98	0,0739%	
ICATÚ VANGUARDA DTVM S/A	R\$ 31.221,70	R\$ 382.126.566,44	1,2239%	
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 752.932,56	R\$ 378.610.691,23	0,0503%	
BANCO BTG	R\$ 196.984,30	R\$ 350.596.319,90	0,1780%	
BANCO SAFRA	R\$ 105.365,77	R\$ 194.251.586,60	0,1844%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	R\$ 290.547,70	R\$ 189.632.006,40	0,0653%	
OCCAM BRASIL GESTÃO	R\$ 16.029,12	R\$ 135.177.418,55	0,8433%	
AZ QUEST INVESTIMENTOS	R\$ 15.424,23	R\$ 90.230.730,64	0,5850%	
PLURAL INVEST GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 3.477,97	R\$ 69.865.447,25	2,0088%	
SULAMERICA INVESTIMENTOS	R\$ 27.874,92	R\$ 32.866.562,83	0,1179%	
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL LTDA	R\$ 24.135,73	R\$ 28.983.588,91	0,1201%	
VINCI PARTNERS	R\$ 13.079,43	R\$ 10.113.585,56	0,0773%	
BRASIL CAPITAL	R\$ 8.708,38	R\$ 9.878.845,32	0,1134%	

Quadro 43.

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.

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <http://www.portaldossegurado.am.gov.br:85/validar>
 e valide o código: NTE0MTE





Gráfico 9.

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.960.961.790,87
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 692.878.455,85
TÍTULOS - CVS	R\$ 9.868.456,72
IMÓVEIS	R\$ 61.835.325,18
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 29.725.838,63
TOTAL	R\$ 5.755.269.867,25

Quadro 44.

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <http://www.portalidosegurado.am.gov.br:85/validar>
 e valide o código: NTE0MTE



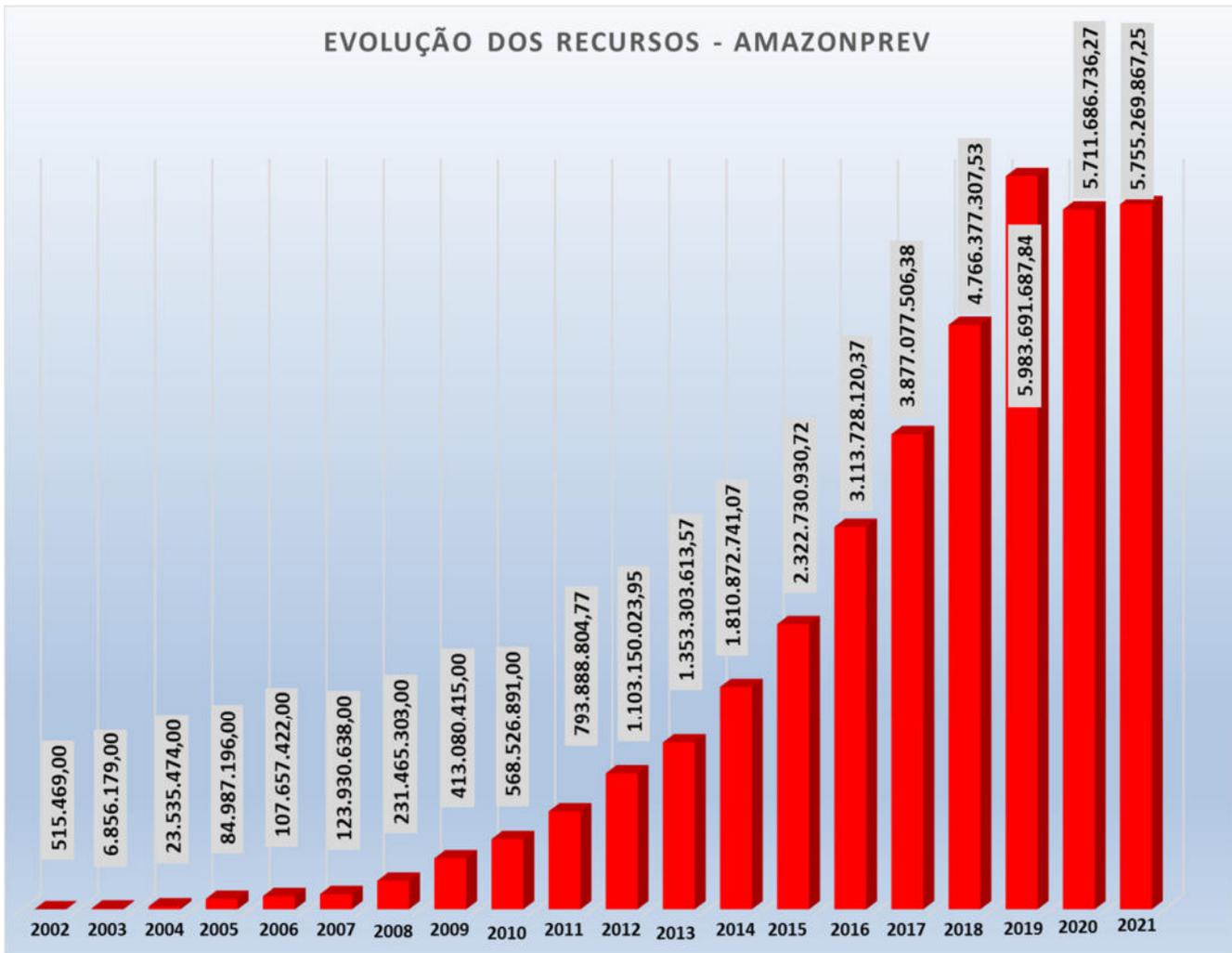


Gráfico 10.

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesse: <http://www.portaldossegurado.am.gov.br:85/validar>
 e valide o código: NTE0MTE



13. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV EXECUTIVO:	a) Novos Recursos: Direcionar para o fundo Itaú Private MM SP500 BRL FICFI (26.269.692/0001-61)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/06/2021
	b) Recursos Atuais: Resgatar o valor total aplicado no fundo Bradesco Institucional IBRx Alpha (14.099.976/0001-78) Resgatar R\$ 50 milhões do fundo Icatu Vanguarda Dividendos FIA (08.279.304/0001-41) Zerar posição no fundo Santander Seleção Crescimento (29.549.642/0001-26) Direcionar o valor de R\$ 77 milhões para o fundo TARPON GT 30 FIC FIA (CNPJ: 35.726.741/0001-39), rateando o saldo restante entre os fundos VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA (CNPJ: 28.470.587/0001-11) e Brasil Capital RP Institucional FIC FIA (40 129 641 0001 65)		
FPREV ALE:	Novos Recursos: Direcionar para o fundo Brasil Capital RP Institucional FIC FIA (40.129.641/0001-65)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/06/2021
FPREV MPE/PGJ:	Novos Recursos: Direcionar para o fundo Bradesco Institucional IBRx Alpha (14.099.976/0001-78)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/06/2021
FPREV - DPE/AM	Novos Recursos: Direcionar para o fundo Bradesco Institucional IBRx Alpha (14.099.976/0001-78)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/06/2021
FPREV - TJ/AM	Novos Recursos: Direcionar para o fundo Bradesco Institucional IBRx Alpha (14.099.976/0001-78)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/06/2021
FPREV - TCE/AM	Novos Recursos: Direcionar para o fundo Bradesco Institucional IBRx Alpha (14.099.976/0001-78)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/06/2021
FFIN (Executivo, ALE, TCE, TJA, MPE, DPE)	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	15/06/2021
RECURSOS COMPREV	Direcionar para o fundo Bradesco DI Premium RF.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/06/2021
DISPONIBILIDADES DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	Os Novos Recursos repassados pelo Poder Executivo, devem ser aplicados no fundo Maxi Poder Público, direcionando o residual, se houver, para o Fundo Caixa Gestão Estratégica. Aos valores repassados pelos demais órgãos serão mantidas as aplicações atuais. Havendo necessidade, a GERAF/COFIN pode solicitar transferência de valores da Caixa para o Bradesco.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/06/2021

Quadro 45.

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

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <http://www.portaldossegurado.am.gov.br:85/validar>
 e valide o código: NTE0MTE





AMAZONPREV
Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



RELATÓRIOS - 2021

RELATÓRIO DE RISCOS FPREV - AMAZONPREV

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <http://www.portaldosegurado.am.gov.br:85/validar>
e valide o código: NTE0MTE



Relatório de Investimentos – Abril/2021

035

035

SALDOS E PERFORMANCE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO - FPREV AMAZONPREV	TOTAL APLICADO	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Prev RF Alocacao Ativa Fcf	R\$ 475.508.203,00	3,05%	0,32%	-2,14	4,05%	0,62%	-1,27%
BB Prev RF Tit Publ VII FI	R\$ 6.945.557,64	1,59%	0,16%	-0,71	7,39%	0,40%	1,07%
BB Prev RF Ima-B5+ Tp FI	R\$ -	9,45%	0,98%	-7,54	9,90%	0,48%	-4,67%
Bradesco Fc FI RF Alocacao Dinamica	R\$ 48.679.126,58	3,26%	0,34%	-2,49	3,36%	0,53%	-1,54%
Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	R\$ 59.413.648,43	2,67%	0,28%	-1,14	8,14%	0,94%	0,22%
Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	R\$ 3.817.400,24	0,32%	0,03%	-0,55	1,56%	0,17%	0,60%
Caixa FI Brasil 2020 V Tp RF	R\$ -			-0,12			
Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	R\$ 53.379.206,77	5,16%	0,53%	-4,08	4,24%	1,48%	-2,47%
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	R\$ 484.524.336,27	2,49%	0,26%	-1,22	8,62%	0,86%	0,63%
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	R\$ 759.179.205,32	2,48%	0,26%	-1,49	4,63%	0,66%	0,48%
Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	R\$ 30.162.395,91	3,07%	0,32%	-1,36	11,70%	1,23%	1,38%
Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	R\$ 109.469.933,64	2,56%	0,26%	-1,23	8,49%	0,88%	0,58%
Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	R\$ 60.597.964,35	9,49%	0,98%	-7,51	9,92%	0,43%	-4,80%
Itau Instit Alocacao Dinamica RF FICFI	R\$ 108.700,94	0,67%	0,07%	-0,57	2,02%	0,11%	0,45%
Safra Ima Institucional Fc FI RF	R\$ 28.680.250,82	7,12%	0,74%	-5,22	8,03%	0,60%	-3,71%
BB Prev RF Idka 2 FI	R\$ 458.395.967,93	2,25%	0,23%	-1,10	9,19%	0,84%	0,84%
TOTAL	R\$ 2.578.861.897,84						

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	TOTAL APLICADO	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	abr/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Acoes Valor Fc FIA	R\$ 155.545.582,61	22,97%	2,37%	-11,54	48,88%	2,32%	-0,33%
BB Mult Global Select Equity Ie FI	R\$ 108.241.663,54	23,66%	2,46%	-8,80	50,85%	0,98%	16,78%
BB Acoes Esg FIA - Bdr Nivel I	R\$ 80.255.295,41	22,90%	2,37%	-12,65	36,98%	0,38%	14,00%
Bradesco FIA Mid Small Caps	R\$ 176.326.547,56	21,75%	2,25%	-10,66	39,11%	4,34%	3,91%
Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	R\$ 92.996.081,47	22,21%	2,30%	-9,65	48,37%	3,19%	0,63%
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	R\$ 334.039.484,26	22,12%	2,29%	-7,35	42,42%	0,99%	-0,48%
BTG Pactual Economia Real FIP	R\$ 6.745.596,57						
Caixa FIA Consumo	R\$ 63.471.772,14	23,40%	2,42%	-10,65	27,18%	0,77%	-3,94%
Icatu Vanguarda Acoes Ibx FI	R\$ -	22,66%	2,34%	-10,31	53,58%	2,70%	2,50%
Icatu Vanguarda Dividendos FIA	R\$ 181.896.272,54	21,94%	2,27%	-13,55	27,68%	1,67%	-1,27%
Itau Acoes Dunamis Fc	R\$ 179.936.971,66	22,04%	2,28%	-8,11	47,13%	3,31%	4,45%
Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	R\$ 41.031.880,04	21,95%	2,27%	-9,78	44,07%	2,83%	0,32%
Itau Institucional Acoes Phoenix Fc	R\$ 65.634.685,83	26,18%	2,71%	-18,95	35,30%	4,25%	0,33%
Itau Small Cap Master FIA	R\$ 91.901.452,76	23,95%	2,48%	-9,56	60,35%	6,88%	8,99%
Sant Selecao Cresc Senior Acoes Fc FI	R\$ 14.617,90	22,44%	2,32%	-9,67	35,02%	1,68%	-4,25%
Santander FI Ibovespa Ativo Inst Acoes	R\$ -	22,55%	2,33%	-10,75	38,70%	1,69%	-1,37%
Sant Selecao Crescimento Acoes Fc FI	R\$ 46.766.080,07	22,43%	2,32%	-9,67	35,08%	1,69%	-4,22%
Santander Global Equities Dólar Master Mult Ie FI	R\$ 142.851.062,63	20,78%	2,15%	-8,91	47,48%	1,05%	14,53%
Safra S P Reais Pb FI Mult	R\$ 24.325.680,39	17,21%	1,77%	-9,70	42,57%	5,36%	12,29%
Safra Consumo Americano FIA Bdr Nivel I	R\$ 141.207.848,68	22,38%	2,31%	-11,99	39,70%	2,67%	14,65%
Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	R\$ 90.230.730,64	21,94%	2,27%	-12,63	48,43%	6,94%	6,51%
Occam Fc de FIA	R\$ 135.177.418,55	22,54%	2,33%	-11,03	47,85%	3,51%	0,72%
Sul America Equities FIA	R\$ 32.866.562,83	23,06%	2,38%	-14,89	36,35%	2,02%	-2,35%
Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	R\$ 28.983.588,91			-8,49		1,24%	15,52%
BTG Pactual Dividendos FIC FIA	R\$ 9.811.239,07	22,15%	2,29%	-12,07	32,14%	0,08%	0,04%
Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	R\$ 34.300.753,66			-10,83		0,77%	4,93%
Vinci Selection Equities FIA	R\$ 10.113.585,56	20,02%	2,07%	-8,89	39,50%	2,31%	-0,23%
Brasil Capital Master 30 II FIA	R\$ 9.878.845,32	22,47%	2,33%	-9,05	54,06%	2,42%	1,22%
Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	R\$ 35.564.693,59			-8,60		1,07%	5,89%
TOTAL	R\$ 2.320.115.994,19						

TOTAL GERAL R\$ 4.898.977.892,03

Quadro 1.

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

Documento assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesse: <http://www.portalidosegurado.am.gov.br:85/validar>
 e valide o código: NTE0MTE



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.

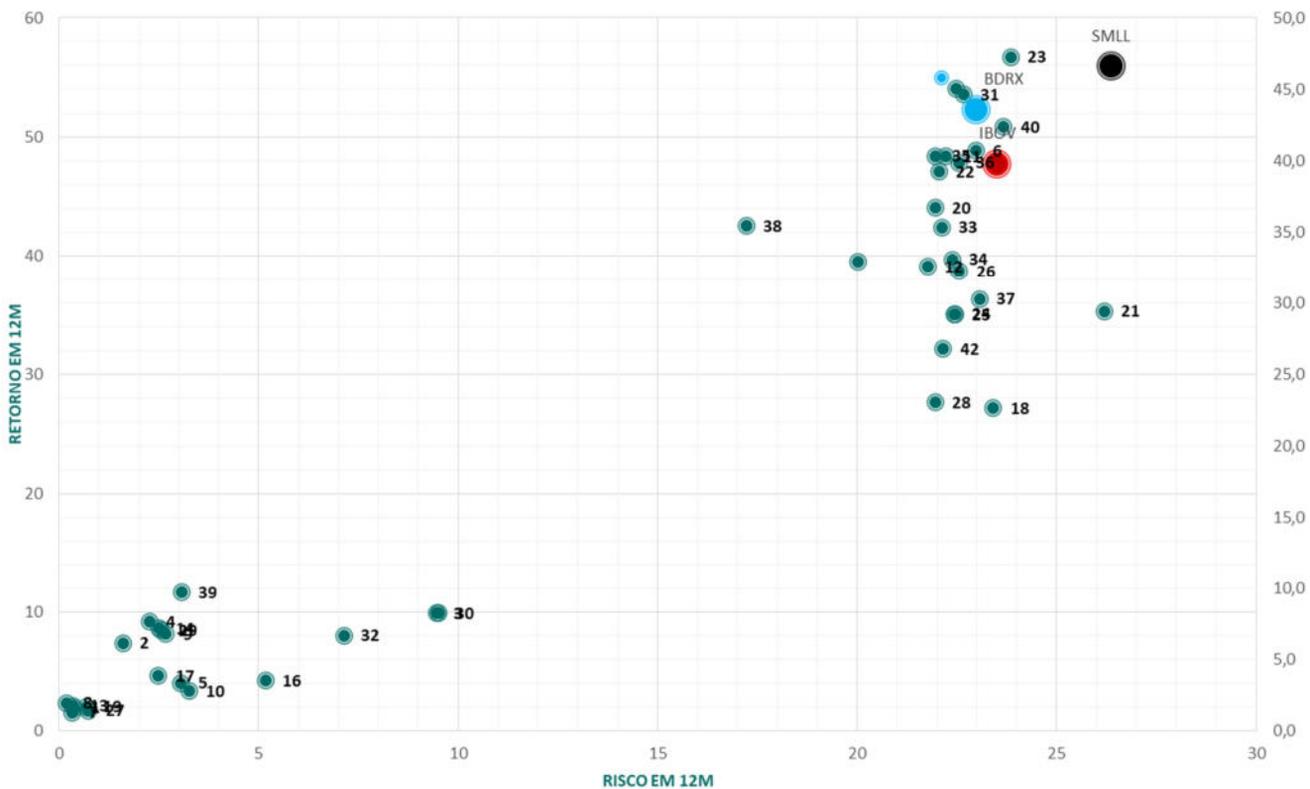


Gráfico 1: Análise Risco x Retorno (12 M)

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <http://www.portalidosegurado.am.gov.br:85/validar>
 e valide o código: NTE0MTE
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25



Nº	Fundos	Código	Retorno	Volatilidade
1	BB Prev RF Irf M1 Tit Publ Fc	239003<BraNa>	1,94	0,35
2	BB Prev RF Tit Publ VII FI	390739<BraNa>	7,39	1,59
3	BB Prev RF Ima-B5+ Tp FI	272620<BraNa>	9,90	9,45
4	BB Prev RF Idka 2 FI	272612<BraNa>	9,19	2,25
5	BB Prev RF Alocacao Ativa Fcfi	423041<BraNa>	4,05	3,05
6	BB Acoes Valor Fc FIA	458236<BraNa>	48,88	22,97
7	Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	179991<BraNa>	1,56	0,32
8	Bradesco FI RF Ref DI Premium	071171<BraNa>	2,35	0,17
9	Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	374131<BraNa>	8,14	2,67
10	Bradesco Fc FI RF Alocacao Dinamica	456306<BraNa>	3,36	3,26
11	Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	326712<BraNa>	48,37	22,21
12	Bradesco FIA Mid Small Caps	131679<BraNa>	39,11	21,75
13	FI Caixa Brasil Irf M 1 Tp RF	248975<BraNa>	2,12	0,33
14	FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	251496<BraNa>	8,62	2,49
15	Caixa FI Brasil 2020 V Tp RF	401854<BraNa>		
16	Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	401862<BraNa>	4,24	5,16
17	Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	427683<BraNa>	4,63	2,48
18	Caixa FIA Consumo	302198<BraNa>	27,18	23,40
19	Itau Instit Alocacao Dinamica RF FICFI	399892<BraNa>	2,02	0,67
20	Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	208507<BraNa>	44,07	21,95
21	Itau Institucional Acoes Phoenix Fc	424838<BraNa>	35,30	26,18
22	Itau Acoes Dunamis Fc	423701<BraNa>	47,13	22,04
23	Small Cap Valuation Fc Acoes	025127<BraNa>	56,74	23,84
24	Sant Selecao Crescimento Acoes Fc FI	464066<BraNa>	35,08	22,43
25	Sant Selecao Cresc Senior Acoes Fc FI	053872<BraNa>	35,02	22,44
26	Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes	055840<BraNa>	38,70	22,55
27	Santander RF Ativo Fc FI	440264<BraNa>	1,71	0,73
28	Icatu Vanguarda Dividendos FIA	173126<BraNa>	27,68	21,94
29	Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	231932<BraNa>	8,49	2,56
30	Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	244953<BraNa>	9,92	9,49
31	Icatu Vanguarda Acoes Ibx FI	127558<BraNa>	53,58	22,66
32	Safra Ima Institucional Fc FI RF	478180<BraNa>	8,03	7,12
33	BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	252311<BraNa>	42,42	22,12
34	Safra Consumo Americano FIA Bdr Nivel I	359130<BraNa>	39,70	22,38
35	Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	520772<BraNa>	48,43	21,94
36	Occam Fc de FIA	378100<BraNa>	47,85	22,54
37	Sul America Equities FIA	255173<BraNa>	36,35	23,06
38	Safra S P Reais Pb FI Mult	401447<BraNa>	42,57	17,21
39	Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	367354<BraNa>	11,70	3,07
40	BB Mult Global Select Equity Ie FI	349208<BraNa>	50,85	23,66
41	BTG Pactual Economia Real FIP	249688<BraNa>		
42	BTG Pactual Dividendos FIC FIA	206032<BraNa>	32,14	22,15
43	Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	548049<BraNa>		
44	Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	559024<BraNa>		
45	Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	557862<BraNa>		
46	Vinci Selection Equities FIA	320196<BraNa>	39,50	20,02
47	Brasil Capital Master 30 II FIA	564680<BraNa>	54,06	22,47

Quadro 2. Legenda Gráfico 1.



2. VERIFICAÇÃO DE LASTRO DOS FUNDOS DE RISCO DE CRÉDITO

DATA BASE EM 30.04.21

TABELA - DURATION & YIELD POR CLASSE			
Ativo	Duration	Spread	% PL
DEB	3,60	1,71%	59,8%
CRI	0,00	0,00%	0,0%
LF	2,68	1,69%	14,0%
CDB	1,51	0,72%	0,0%
DPGE	0,00	0,00%	0,0%
NP	1,17	2,81%	1,0%
BOND	0,00	0,00%	0,0%
FIDC	0,00	0,00%	0,0%
NTN-B	3,89	-	17,1%
Over	0,00	-	8,0%
Carteira Crédito	3,39	1,72%	74,9%
Crédito - Contribuição Fundo	1,46	1,29%	74,9%
Fundo (Inclui DAP e NTN-B)	2,90	1,29%	100,0%

Quadro 03

TABELA - RATING EXTERNO*		
Rating	Financeiro	% PL
AAA	200.291.301	20,9%
AA+	115.908.271	12,1%
AA	161.817.445	16,9%
AA-	116.255.615	12,1%
A+	62.879.718	6,5%
DPGE	0	0,0%
A	0	0,0%
A-	18.744.214	2,0%
BBB+	0	0,0%
BBB	0	0,0%
BBB-	0	0,0%
BB+	0	0,0%
BB	0	0,0%
BB-	0	0,0%
B+	0	0,0%
B	0	0,0%
B-	10.018.695	1,0%
CCC	0	0,0%
CC	0	0,0%
C	0	0,0%
Sem Rating	33.439.782	3,5%
Tesouro / Over	240.875.958	25,1%
Total	960.231.001	100,0%

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

Quadro 04.

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <http://www.portaldosegurado.am.gov.br:85/validar>
 e valide o código: NTE0MTE



TABELA - SETOR		
Setor	Financeiro	% PL
Elétrico	189.151.981	19,7%
Bancos	135.011.274	14,1%
Saneamento	92.461.186	9,6%
Conc. Rodoviárias	81.437.173	8,5%
Serviço	75.862.128	7,9%
Varejo	42.905.340	4,5%
Shopping Center	35.607.087	3,7%
Logística	22.836.856	2,4%
Infraestrutura	15.878.881	1,7%
Mineração e Siderurgia	10.960.069	1,1%
Óleo e Gás	7.735.934	0,8%
Indústria e Comércio	5.382.341	0,6%
Papel e Celulose	4.124.793	0,4%
Tesouro / Over	240.875.958	25,1%
Total	960.231.001	100,0%

Quadro 05.

Nota: Dados referentes ao fundo ICATU VANGUARDA FI RF INFLACÃO CREDITO PRIVADO LP. (base: 30/04/2021)

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <http://www.portaldosegurado.am.gov.br:85/validar>
 e valide o código: NTE0MTE



PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 17 de maio de 2021, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de abril/2021, 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, são acompanhadas pelo Controles Internos, e aprovadas pela Diretoria, com base nas Atas de Reunião do Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev.

Manaus – AM, 17 de maio de 2021.

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

Marcos Souza
Membro

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <http://www.portaldosegurado.am.gov.br:85/validar>
e valide o código: NTE0MTE



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:

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <http://www.portaldosegurado.am.gov.br:85/validar>
e valide o código: NTE0MTE



APROVAÇÃO DO CONSELHO DE ADMINISTRAÇÃO - 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:

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2021 11:01:14
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/05/2021 11:13:05
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2021 12:19:47
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2021 12:36:25

Documento assinado eletronicamente 51411/2021
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <http://www.portaldosegurado.am.gov.br:85/validar>
e valide o código: NTE0MTE

