

Processo: **2022.A.00317**

Destino: DIRAF / PRESI

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

Data: 18/01/2022

RELATÓRIO Nº. 001 / 2022 – COMIV

Senhores Diretores,

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

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 03 a 07);
- 2) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Poder Executivo, apresentando os saldos e **performance** dos Fundos de Investimentos, evolução dos saldos dos Fundos de Investimentos, imóveis e CVS, comparativo da rentabilidade com a Meta Atuarial, Evolução e variação dos recursos do FPREV Executivo (páginas 07 a 13);
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 14 a 16);
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (página 17 a 18);
- 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 21 a 22)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (página 23 a 24)
- 8) Rentabilidade do Fundo Previdenciário - Consolidado – FPREV (página 25 a 26)
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro – (páginas 26 a 27)
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 28)
- 11) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 29 a 35)
- 12) Total dos Recursos e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (página 36)
- 13) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 37)
- 14) Relatório de Riscos da Carteira (página 38 a 46)
- 15) Parecer do Comitê de Investimentos (página 47).

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:17
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:31
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARRIOS em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEwMzIx



1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

Brasil: Ata reforça o cenário de Selic em patamar significativamente contracionista

Mundo: Bancos centrais anunciam redução do grau de estímulo monetário

Na ata da última reunião do comitê de política monetária (Copom), na qual a Selic foi elevada de 7,75% para 9,25%, a grande novidade ficou por conta da pior avaliação do balanço de riscos para a inflação e pela desancoragem das expectativas, inserindo viés altista para as projeções no cenário básico. Nesse sentido, o comitê avalia que é necessária a manutenção do ciclo de aperto monetário mais contracionista do que o utilizado no cenário básico por todo o horizonte relevante. Além de simular ritmos diferentes de alta da Selic, os membros também consideraram cenários com a taxa de juros permanecendo elevada por um período mais longo do que o implícito no cenário básico, optando pela manutenção do ritmo de alta em 1,5 p.p. O documento reafirma o cenário de compromisso do Banco Central em garantir a convergência da inflação para a meta ao longo de 2022 e 2023. Na reunião de fevereiro, o Copom deverá elevar a taxa de juros em 150 pb, para 10,75% a.a. O ciclo atual de aperto deverá ser encerrado em 11,75% na reunião de março, com uma alta de 100 pb. Esse patamar da Selic deverá ser mantido ao longo de todo o ano.

Em dezembro, a prévia da inflação ao consumidor (IPCA -15) variou 0,78%, ante avanço de 1,17% em novembro. A inflação acumulada em 12 meses apresentou desaceleração, de 10,7% no fechado de novembro para 10,4% em dezembro. Dentro das surpresas baixistas, o grupo Higiene Pessoal teve o maior impacto, com queda de -3,34%, causando menor inflação de bens industriais. Já em serviços, destaque para alimentação fora do domicílio (0,08%), também influenciada por promoções da Black Friday. No entanto, o núcleo de serviços subjacentes ex-alimentação fora do domicílio teve alta de 0,88% no mês, apresentando aceleração em relação a tendência dos últimos meses. Com relação aos núcleos, que são métricas que excluem ou suavizam itens voláteis, a desaceleração frente ao mês de novembro foi mais intensa do que o esperado. Em dezembro, a média da variação dos núcleos dessazonalizada passou de 0,83% para 0,73%, ante expectativa de 0,78%. Em 12 meses, a média dos núcleos alcançou 7,4%. O IPCA deverá encerrar 2021 com variação de 9,9%, projetado pela BRAM.

Incorporando as surpresas negativas com a atividade em outubro, o Índice de atividade econômica do Banco Central (IBC-Br) teve retração de 0,4% na margem. Na comparação interanual, o índice teve queda de 1,5%. O indicador repercutiu a queda na margem do volume de serviços (-1,2%), das vendas do varejo (-0,9%) e da produção industrial (-0,6%) no mês. Com o resultado, o IBC-Br se encontra 1,6%

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARRON em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEWmZLx



abaixo do nível pré-crise. O dado de outubro representou queda de 0,9% em relação à média do 3º trimestre. De forma geral, o resultado mostra um quadro menos favorável para o PIB no 4º trimestre. Nos EUA, o Fed anunciou uma nova redução do programa de compras de ativos, enquanto as projeções confirmaram altas de juros no próximo ano. Conforme o esperado, o Comitê anunciou que a partir do final de janeiro as compras de títulos do Tesouro serão reduzidas mensalmente em US\$ 20 bilhões, enquanto os títulos do mercado imobiliário serão reduzidos mensalmente em US\$ 10 bilhões. Nesse ritmo, que poderá ser alterado segundo o comunicado, o programa de compras estaria finalizado em março ao invés de junho, como indicado na reunião de novembro. A respeito do cenário, a leitura de que a inflação é majoritariamente transitória foi excluída, em linha com revisões altistas para a inflação. Para 2022, a projeção para o núcleo de inflação saiu de 2,3% em setembro para 2,7%, enquanto que para 2023 a projeção subiu de 2,2% para 2,3%. No mercado de trabalho, a taxa de desemprego em 3,5% já deverá ser alcançada em 2022 ao invés de 2023, como indicava a projeção anterior. Por fim, a perspectiva sobre a trajetória de juros dos membros sofreu alterações relevantes. A mediana dos votos, que indica a visão de cada membro do Fed, apontou para três altas de juros em 2022, enquanto na reunião anterior o comitê ainda estava dividido sobre elevar os juros em 2022. Na entrevista após a reunião, o presidente do Fed, Jerome Powell, mostrou preocupação com a disseminação da alta de preços e sinalizou que mesmo que o mercado de trabalho não atinja o pleno emprego, o Fed deverá iniciar o ciclo de aperto monetário no próximo ano. Em linhas gerais, a decisão reforça o cenário de aumento de juros pelo Fed no próximo ano. O cenário esperado é contemplado três altas de juros em 2022, com a primeira elevação provavelmente em junho.

Na Europa, os bancos centrais também adotaram políticas de redução do estímulo monetário. No caso do Banco Central Europeu (BCE), o Programa Pandêmico de Compras Emergenciais (PEPP, na sigla em inglês), com volume de compras € 1,85 trilhão em compra de ativos, não deverá ter continuidade após março de 2022. Para atenuar o impacto nas condições financeiras desse encerramento, o BCE deverá aumentar temporariamente o programa tradicional de compra de ativos, atualmente em € 20 bilhões ao mês. Nesse caso, entre o segundo trimestre e o mês de outubro, serão adicionados ao programa cerca de € 90 bilhões. Vale mencionar, que diferentemente do Fed, a projeção de inflação no horizonte mais longo se encontra em 1,8%, abaixo da meta de 2%, afastando a possibilidade de alta de juros no próximo ano. O Banco Central da Inglaterra (BoE) também elevou a taxa de juros em 15 pontos base, para 0,25%, sendo que a expectativa era de manutenção dos juros. A inflação elevada e os sinais contundentes de aperto no mercado de trabalho balizaram a decisão, apesar das incertezas a respeito da evolução da nova variante (Ômicron) no país. O BoE indicou que o cenário prescreve um aperto modesto da política monetária, indicando ao menos mais uma alta de juros em 2022.



Por fim, na China, os dados mostraram alguma melhora do lado da oferta, enquanto a demanda surpreendeu negativamente. Na comparação interanual, a indústria apresentou expansão de 3,8%, representando o segundo mês consecutivo de aceleração. Já as vendas no varejo desaceleraram de 4,9% para 3,9%, abaixo do consenso de mercado (4,8%). Os investimentos em ativos fixos (FAI) tiveram variação de 5,2%, também abaixo da variação de 6,1% em outubro. Nossa expectativa é de crescimento de 8,1%, embora as recentes frustrações no setor imobiliário insiram viés de baixa para a projeção. Esse viés de baixa também se mantém para a projeção de 5% em 2022.

Perspectivas Renda Fixa

A inflação segue como maior receio no mês, somado à incerteza sobre a evolução da atividade econômica devido ao surto de Ômicron. Os bancos centrais pelo mundo têm carregado mais a tinta ao descrever o ambiente inflacionário, que está levando as economias emergentes a uma elevação de juros e os países desenvolvidos a planejar a sua retirada de estímulos. Nesse sentido, o mercado vê o FED acelerando o processo de redução de compras de títulos, com previsão de término em março, sendo essa data um marco para início do aperto monetário. Segue-se em um ambiente com uma demanda descolada para o consumo de bens, em que o gargalo no setor logístico persiste. Ainda assim, o PIB global retomou a trajetória de expansão anterior à pandemia, mantendo-se para o próximo ano acima da média histórica. Para 2022, mantém-se a incerteza do rebalanceamento do consumo para serviços, ambiente inflacionário e maior desaceleração da economia chinesa.

O cenário para as economias emergentes é desafiador. Além da incerteza de um viés de baixa da economia chinesa, para o Brasil o ano será marcado pelo cenário eleitoral, que costuma ser volátil. Entretanto, dois desequilíbrios estão presentes, sendo o inflacionário, que mais chama a atenção pelo amplo impacto no mundo, e a necessidade de retomada do ajuste fiscal. A necessidade de aperto monetário mais elevado, conforme apontado pelo banco central, apontam para uma desaceleração da atividade econômica no próximo ano. Para 2022, a gestão espera um PIB por volta de 0,4%, inflação de 5,4% e uma Selic de 11,75%.

O mercado de renda fixa obteve um resultado bastante positivo nesse mês, principalmente os ativos prefixados. O destaque negativo foi para o IMA-B 5+ por causa do aumento das taxas reais mais longas. Adicionalmente, os níveis de juros permanecem em um patamar elevado. Percebe-se uma queda das taxas prefixadas de médio e longo prazo, piorando a situação de inclinação negativa da curva. Ainda nesse sentido, os ativos atrelados à inflação de médio prazo também cederam. As LFTs, ativos pós-fixados em Selic, seguem com resultados superiores ao CDI no mês e no ano. Já o IMA-S, índice da Anbima fechou o mês com 101,11% e o ano com 105,59% do CDI. O Real obteve um desempenho



positivo sobre o Dólar, isso reforça a menor intensidade dos movimentos da moeda. O Dólar fechou o mês a 5,58, com uma queda de -0,70%, acumulando uma alta de 7,38% no ano.

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA FIXA



Fonte: Carta do Gestor janeiro/2022 – BRAM.

Perspectivas Renda Variável

Dezembro foi um mês de recuperação de alguns setores que se destacaram negativamente no mês passado. Dados mais recentes indicam que a nova variante Ômicron, apesar de ser muito mais contagiosa, tem gerado números relativamente baixos de internações, colocando em dúvida seus efeitos colaterais para economia. Outro destaque foi a mudança de postura do Fed indicando antecipação do processo de retirada de estímulos e alta de taxa de juros, impactando em especial o setor de tecnologia que está extremamente valorizado e, por isso, acaba sendo muito sensível a altas nas taxas de juros.

O S&P 500 teve retorno de +4,36% e o MSCI Emerging Markets +1,62%. Estes índices acumulam retorno no ano de +26,89% e -4,59% respectivamente e em moeda original.

No Brasil, além dos fatores globais, as preocupações em torno do risco fiscal continuam diminuindo na margem, mas permanece o clima de baixa na expectativa de crescimento do PIB para 2022. O Ibovespa teve retorno de +2,85% no mês, acumulando retorno negativo de -11,93% no ano. O fluxo do investidor estrangeiro foi positivo em dezembro, encerrando o ano com cerca de R\$ 48 bilhões, um recorde histórico, demonstrando que a percepção de risco é relativa e diferenciada entre os investidores nos preços atuais. A gestão acredita que o horizonte de tempo dos investidores faz o papel de diferenciação entre os estrangeiros e os investidores locais, que tem diminuído sua exposição na renda variável local. Além disso, segue com visão cautelosa para renda variável no curto prazo. O aumento das incertezas locais e globais motiva tal posicionamento. O resultado resiliente das empresas listadas e o crescimento global do PIB proporcionado pelo mundo pós-COVID, são os fatores positivos. No local, risco político, inflação e risco fiscal permanecem como pontos de atenção. Já no global, a perspectiva de redução de liquidez como reação a escalada da inflação e o impacto das novas variantes da COVID-19 são os



principais riscos do momento. Para a gestão, o balanço de forças entre atividade positiva no mundo, porém com expectativa de retirada de estímulos nos países desenvolvidos, e ambiente local mais incerto 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 se tem pela frente.

Sobre a performance setorial, os setores cíclicos globais e locais como Mineração & Siderurgia, Energia, Bens de Capital & Serviços, Papel, Celulose & Madeira e Imobiliário se destacaram positivamente após o resultado ruim de novembro. Por outro lado, setores que também têm características cíclicas foram destaque negativo, e estão sofrendo revisões em suas expectativas de lucro para 2022 com Bancos, Educação e Tecnologia.

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA VARIÁVEL

	DEZEMBRO	2021	12 MESES	24 MESES	36 MESES
S&P 500 USD	4,36%	26,89%	26,89%	47,52%	90,13%
MSCI WORLD USD	4,19%	20,14%	20,14%	37,03%	71,54%
SMLL CAPS	3,80%	-16,20%	-16,20%	-16,75%	31,71%
IBRX100	3,14%	-11,17%	-11,17%	-8,07%	22,63%
IDIV	1,60%	-6,41%	-6,41%	-7,35%	34,49%
IBOVESPA	2,85%	-11,93%	-11,93%	-9,36%	19,27%

Fonte: Carta do Gestor janeiro/2022 – BRAM.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEWmZLx



Relatório de Investimentos – Dezembro/2021

008

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

2.1 SALDOS E PERFORMANCE RENDA FIXA

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)				
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 318.295.997,28	R\$ 271.047.525,22	(1,6263)	1,7339	0,9141	0,9942%	-0,3984%	-0,3984%
BB PREVID TP VII	R\$ 7.079.089,17	R\$ 7.120.337,67	(0,4962)	1,7354	0,5826	1,8204%	6,5673%	6,5673%
BB PREVID IDKA 2	R\$ 298.527.614,30	R\$ 300.635.822,30	(1,2527)	2,4291	0,7062	1,8603%	4,6456%	4,6456%
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 27.323.162,17	R\$ 27.544.534,01	0,5800	0,6400	0,8100	2,0436%	4,9400%	4,9400%
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 299.531,26	R\$ 75.287,33	0,4800	0,5700	0,6900	1,7500%	4,2045%	4,2045%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 53.088.094,00	R\$ 53.538.599,32	(1,4900)	2,7100	0,8500	2,0396%	2,7700%	2,7700%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 488.617.878,32	R\$ 492.367.703,98	(1,2440)	2,4678	0,7674	1,9697%	4,3127%	4,3127%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 370.262.781,85	R\$ 373.319.988,18	(0,6612)	0,9059	0,8257	1,0664%	-0,1090%	-0,1090%
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 28.840.676,76	R\$ 29.159.159,12	(2,4300)	3,1800	1,1000	1,7801%	4,8600%	4,8600%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 92.691.813,36	R\$ 93.399.609,36	(1,2400)	2,5000	0,7600	1,9983%	4,1400%	4,1400%
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 112.807.769,26	R\$ 112.387.683,11	(3,8700)	4,4400	(0,3700)	0,0267%	-6,9600%	-6,9600%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 21.841,78	R\$ 22.029,78	(0,3600)	1,6400	0,8600	2,1451%	4,5300%	4,5300%
SANTANDER CP CRESCIMENT INST	R\$ 99.044.974,59	R\$ 107.652.513,38	0,6774	0,5966	0,7678	2,0557%	2,2638%	NC
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 25.973.110,33	R\$ 34.040.408,86	0,6100	0,6800	0,8400	2,1450%	6,2900%	6,2900%
BTG PACTUAL CRED CORP FIC FI RF CP	R\$ 7.702.655,51	R\$ 34.855.852,12	-	0,6065	0,3388	0,9474%	0,9474%	NC
ITAU HIGH GRADE RF DP FIC FI	R\$ 53.345.940,97	R\$ 61.624.409,75	0,6300	0,6400	0,8100	2,0944%	5,1600%	5,1600%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 131.098.727,06	R\$ 133.951.797,73	(3,2300)	3,2400	(0,1000)	-0,1946%	-4,8600%	-4,8600%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 2.115.021.657,97	R\$ 2.132.743.261,22						

Quadro 1.

2.2 SALDOS E PERFORMANCE RENDA VARIÁVEL

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)				
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 97.799.184,35	R\$ 101.786.211,51	(5,5414)	(0,8673)	4,0767	-2,5432%	-4,7614%	-4,7614%
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ -	R\$ 50.145.820,90	-	-	0,2900	0,2900%	0,2900%	NC
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 147.266.685,61	R\$ 152.999.296,21	(12,5400)	(3,1700)	3,8900	-12,0181%	-9,8400%	-9,8400%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 229.424.304,27	R\$ 227.851.827,32	(13,0596)	(6,7100)	(0,6854)	-19,4492%	-31,7900%	-31,7900%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FI AÇÕES	R\$ 7.886.600,35	R\$ 7.941.806,13	(8,4938)	(4,3200)	0,7000	-11,8341%	-19,0262%	-19,0262%
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 13.877.804,75	R\$ 13.828.108,17	(0,2881)	(0,3007)	(0,3581)	-0,9439%	13,6198%	13,6198%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ -	R\$ 23.614.189,43	-	-	-	0,0000%	0,0000%	0,0000%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANT	R\$ 11.342.056,59	R\$ 11.997.742,88	(6,0249)	(0,5234)	5,7810	-1,1125%	-4,8165%	NC
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 76.046.531,25	R\$ 76.750.860,53	(6,9600)	(2,1900)	0,9300	-8,1513%	-18,2600%	-18,2600%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 156.101.613,81	R\$ 157.617.379,80	(7,5400)	(1,4400)	0,9700	-7,9875%	-8,5100%	-8,5100%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 33.466.421,25	R\$ 34.095.419,66	(8,7800)	(2,0600)	1,8800	-8,9795%	-16,6400%	-16,6400%
ITAU SMALL CAPS VALUATION	R\$ 100.650.594,60	R\$ 104.186.789,94	(11,0000)	(2,3200)	3,5100	-10,0134%	-10,0600%	-10,0600%
ITAÚ MM SP500 BRL FIC	R\$ 103.897.372,21	R\$ 109.658.401,60	7,6300	(0,5100)	5,5400	13,0134%	32,7400%	32,7400%
SANTANDER CRESC SENIOR (TOP AÇÕES)	R\$ 12.064,20	R\$ 12.327,77	(8,5268)	(4,1435)	2,1847	-10,4014%	-20,5854%	-20,5854%
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 27.147.276,78	R\$ 28.619.821,87	7,5500	(0,5100)	5,4200	12,8010%	32,1100%	32,1100%
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 74.798.444,07	R\$ 76.459.160,97	(6,7900)	(3,7900)	2,2200	-8,3318%	-9,7400%	-9,7400%
OCCAM FIC FIA	R\$ 78.132.767,17	R\$ 80.861.753,24	(4,9000)	(2,6700)	3,4900	-4,2088%	-12,7400%	-12,7400%
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 25.543.886,19	R\$ 26.804.565,85	(11,5680)	(5,6715)	4,9353	-12,4666%	-20,3621%	-20,3621%
BRASIL CAPITAL RP INSTIT FIC AÇÕES	R\$ 40.140.785,00	R\$ 41.113.518,85	(13,2500)	(3,7300)	2,4200	-14,4647%	-22,5000%	-22,5000%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 7.836.757,83	R\$ 8.130.314,94	(8,2413)	(2,7265)	3,7459	-7,3996%	-19,2064%	-19,2064%
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.309.964,96	R\$ 9.256.195,85	(0,5157)	(0,5050)	(0,5775)	-1,5898%	-2,7315%	NC
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 16.548.724,79	R\$ 17.242.753,11	(9,3469)	(3,3841)	4,1938	-8,7415%	-18,3646%	-18,3646%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 97.551.401,37	R\$ 97.670.543,70	(8,3800)	3,5100	0,1200	-5,0503%	-12,8200%	-12,8200%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 37.533.248,57	R\$ 38.807.964,00	(6,8300)	0,0600	3,4000	-3,6044%	-6,5000%	-6,5000%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 22.605.221,39	-	-	(0,7200)	-0,7200%	-1,8900%	-1,8900%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 34.255.367,85	R\$ 35.164.933,77	(8,1200)	(0,6400)	2,6600	-6,2797%	-11,4900%	-11,4900%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.426.569.857,82	R\$ 1.555.222.929,39						

Quadro 2.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEWmZLx



Relatório de Investimentos – Dezembro/2021

009

2.3 SALDOS E PERFORMANCE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 24.982.199,35	R\$ 25.980.390,21	6,7610	(0,7968)	3,9956	10,1421%	32,3477%	32,3477%
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 152.880.147,40	R\$ 154.235.894,63	7,8592	(2,0098)	0,8868	6,6287%	23,3375%	23,3375%
SCHRODER SUSTENT AÇÕES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 31.713.226,62	R\$ 32.233.514,06	7,5613	(2,3300)	1,6400	6,7780%	28,4800%	28,4800%
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 163.204.312,77	R\$ 168.086.619,73	10,6509	(1,2881)	2,9915	12,4931%	33,4942%	33,4942%
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 157.840.206,03	R\$ 163.286.774,60	8,5200	0,2100	3,4500	12,4997%	33,9200%	33,9200%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 39.523.473,43	R\$ 41.389.565,28	7,3109	(0,7084)	4,7214	11,5814%	22,0687%	22,0687%
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 39.539.540,73	R\$ 34.417.308,95	10,8973	0,1499	(12,9547)	-3,3244%	-0,5777%	-0,5777%
TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	R\$ 609.683.106,33	R\$ 619.630.067,46						
TOTAL GERAL	R\$ 4.151.274.622,12	R\$ 4.307.596.258,07						

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: As movimentações nesse mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. 180/2021, devidamente autorizada pela Diretoria: a) Novos Recursos: Ratear entre os fundos MONGERAL AEGON CP FI RF LP (19.488.768/0001-84); SANTANDER RF CP CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP (17.138.474/0001-05); ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC FI (09.093.883/0001-04); BTG PACTUAL CP I FIC DE FI RF CP (: 14.171.644/0001-57), até o limite legal permitido, passando a ser rateados entre os fundos GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA (38.280.883/0001-03) e fundo VINCI SELECTION EQUITIES FIA (15.603.945/0001-75).

Nota 3: As movimentações nesse mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. 181/2021, devidamente autorizada pela Diretoria: a) Novos Recursos: Direcionar para o fundo BTG PACTUAL CP I FIC DE FI RF CP (14.171.644/0001-57) até o limite legal permitido, passando a ser rateados entre os fundos GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA (38.280.883/0001-03) e fundo BTG PACTUAL S&P 500 BRL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (36.499.594/0001-74), respeitando os limites da legislação. b) Recursos Atuais: Migrar R\$ 50 milhões do fundo BB Alocação Ativa (25.078.994/0001-90) para o fundo BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI (07.882.792/0001-14).

2.4 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

INSTITUIÇÃO	out/21	nov/21	dez/21
BRADESCO	R\$ 184.333.551,77	R\$ 174.889.379,04	R\$ 180.619.117,55
BANCO DO BRASIL	R\$ 900.448.923,14	R\$ 909.888.397,22	R\$ 924.802.727,54
CAIXA	R\$ 906.880.194,65	R\$ 923.310.810,76	R\$ 954.838.223,79
ITAÚ	R\$ 445.393.007,89	R\$ 447.483.784,62	R\$ 467.204.430,53
SANTANDER	R\$ 246.822.781,10	R\$ 251.937.186,19	R\$ 261.900.735,78
ICATU	R\$ 304.143.760,11	R\$ 310.386.790,63	R\$ 311.697.312,12
SAFRA	R\$ 304.240.740,93	R\$ 316.086.209,87	R\$ 325.858.394,20
BTG PACTUAL	R\$ 277.436.005,59	R\$ 268.201.329,84	R\$ 293.733.789,59
AZ QUEST	R\$ 77.749.002,16	R\$ 74.798.444,07	R\$ 76.459.160,97
OCCAM BRASIL	R\$ 80.276.208,91	R\$ 78.132.767,17	R\$ 80.861.753,24
SCHRODER	R\$ 32.469.444,97	R\$ 31.713.226,62	R\$ 32.233.514,06
SULAMÉRICA	R\$ 27.079.702,67	R\$ 25.543.886,19	R\$ 26.804.565,85
PLURAL INVEST	R\$ 79.285.823,95	R\$ 79.063.014,16	R\$ 75.806.874,23
BRASIL CAPITAL	R\$ 41.695.707,73	R\$ 40.140.785,00	R\$ 41.113.518,85
BNP PARIBAS	R\$ 8.056.412,45	R\$ 7.836.757,83	R\$ 8.130.314,94
DAYCOVAL	R\$ 17.128.365,89	R\$ 16.548.724,79	R\$ 17.242.753,11
ARX	R\$ 37.510.403,40	R\$ 37.533.248,57	R\$ 38.807.964,00
MONGERAL	R\$ 18.135.389,47	R\$ 25.973.110,33	R\$ 34.040.408,86
VINCI PARTNERS	R\$ 128.715.962,54	R\$ 131.806.769,22	R\$ 132.835.477,47
GUEPARDO	R\$ -	R\$ -	R\$ 22.605.221,39
TOTAL	R\$ 4.117.801.389,32	R\$ 4.151.274.622,12	R\$ 4.307.596.258,07

Quadro 4.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
Documento Assinado por: ANDRÉ LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARRIOS em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEWmZlx



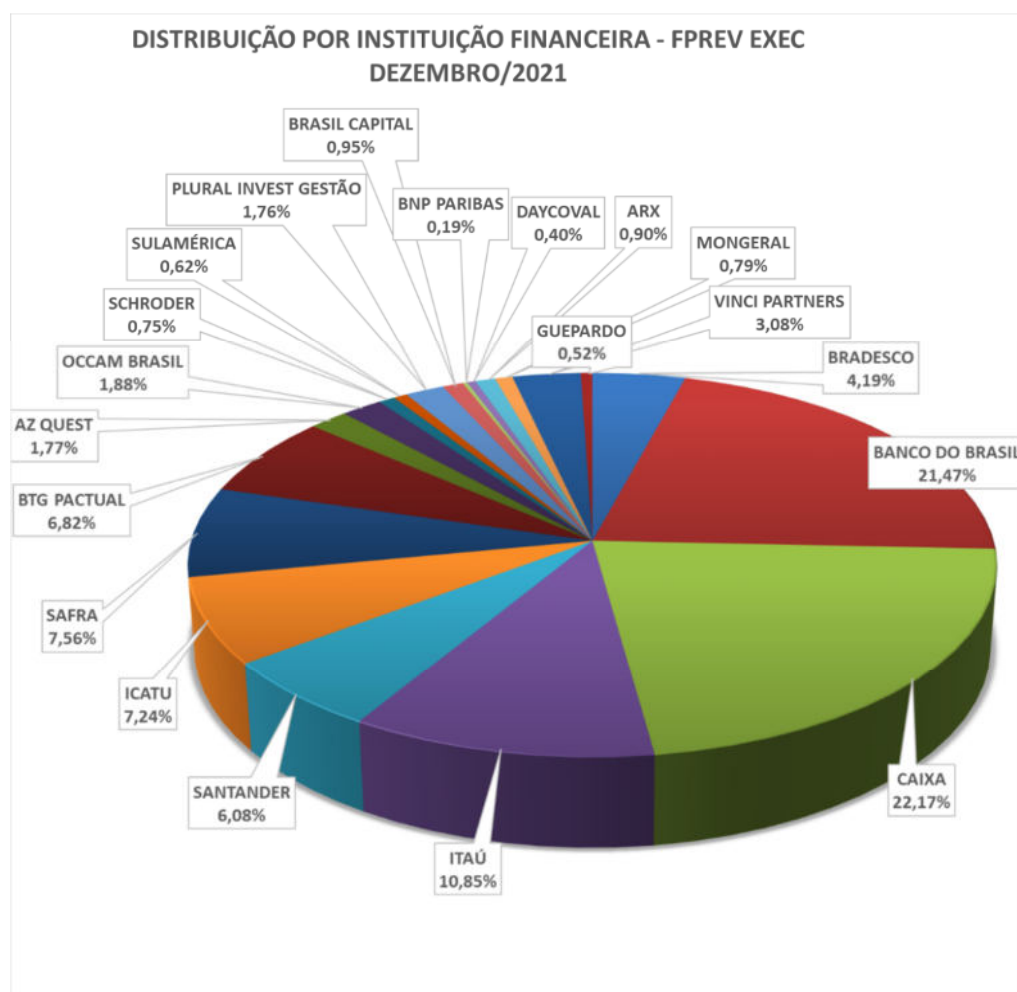


Gráfico 1.

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 176.185.240,52	R\$ 178.402.400,81	1,7812	1,4796	1,2584	4,587%	17,1930%	17,1930%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 184.002.716,08	R\$ 186.335.713,27	1,7907	1,4891	1,2679	4,616%	17,3249%	17,3249%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 189.532.823,63	R\$ 191.980.923,04	1,8145	1,5129	1,2916	4,690%	17,6553%	17,6553%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 191.093.165,04	R\$ 193.516.093,32	1,7907	1,4891	1,2679	4,616%	17,3251%	17,3251%
TOTAL GERAL	R\$ 740.813.945,27	R\$ 750.235.130,45						

Quadro 5.

Nota 1: Títulos Públicos atualizados pelo valor de aquisição acrescido da taxa de juros. (Ver quadro 6).

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEWmZLx



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\$ 178.402.400,81	R\$ 186.335.713,27	R\$ 191.980.923,04	R\$ 193.516.093,32
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.

2.7 ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

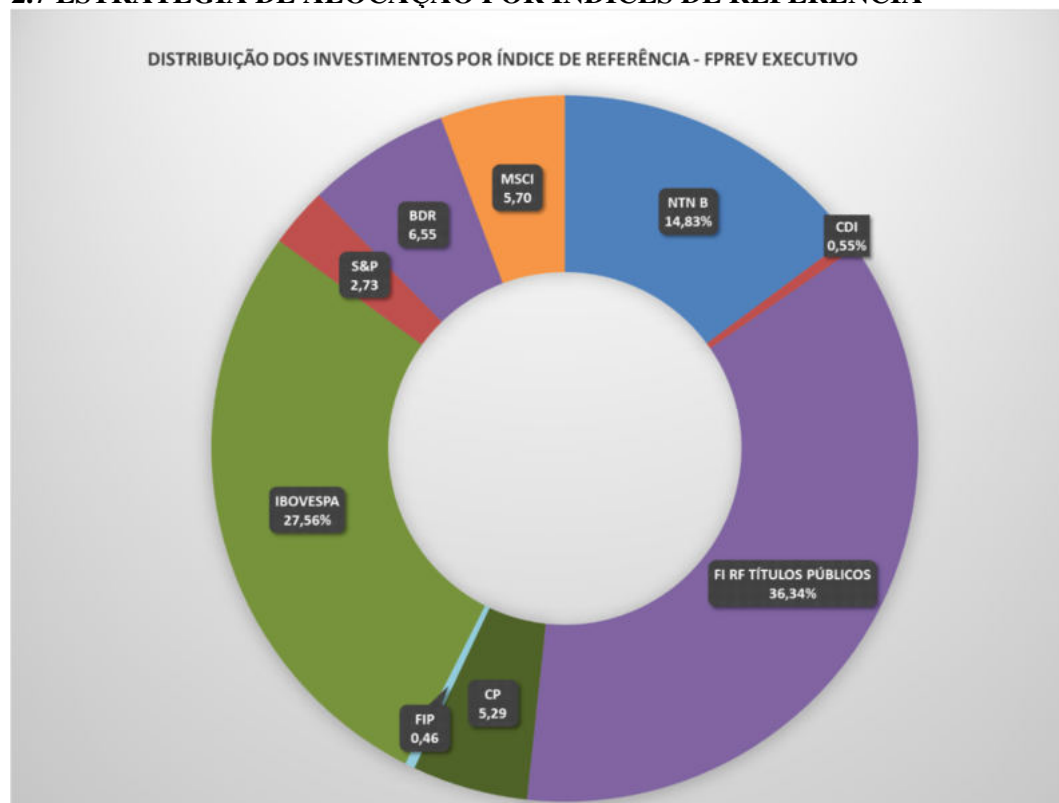


Gráfico 2.

2.8 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	30/11/2021	31/12/2021
CVS - A	R\$ 1.065.466,26	R\$ 1.048.518,02
CVS - B	R\$ 6.893.246,70	R\$ 6.783.585,05
CVS - C	R\$ 138.214,44	R\$ 136.015,88
CVS - D	R\$ 755.936,28	R\$ 743.910,42
TOTAL	R\$ 8.852.863,68	R\$ 8.712.029,37

Quadro 7.



Relatório de Investimentos – Dezembro/2021

012

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
mai/21	R\$ 28.567,21	R\$ 145.084,72	R\$ 173.651,93
jun/21	R\$ 28.147,25	R\$ 145.084,72	R\$ 173.231,97
jul/21	R\$ 27.727,27	R\$ 145.084,72	R\$ 172.811,99
ago/21	R\$ 27.307,30	R\$ 145.084,72	R\$ 172.392,02
set/21	R\$ 26.887,32	R\$ 145.084,32	R\$ 171.971,64
out/21	R\$ 26.887,32	R\$ 145.084,32	R\$ 171.971,64
nov/21	R\$ 26.047,38	R\$ 145.084,72	R\$ 171.132,10
dez/21	R\$ 25.639,76	R\$ 145.100,57	R\$ 170.740,33
TOTAL	R\$ 335.670,36	R\$ 1.741.031,69	R\$ 2.076.702,05

Quadro 8.

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\$ -	R\$ -	R\$ -
mar/21	R\$ -	R\$ 100.364,40	R\$ 100.364,40
abr/21	R\$ 87.271,44	R\$ 100.364,40	R\$ 187.635,84
mai/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -
jun/21	R\$ -	R\$ 301.093,20	R\$ 301.093,20
jul/21	R\$ 43.635,72	R\$ -	R\$ 43.635,72
ago/21	R\$ -	R\$ 100.364,40	R\$ 100.364,40
set/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -
out/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -
nov/21	R\$ -	R\$ 100.364,40	R\$ 100.364,40
dez/21	R\$ 218.178,60	R\$ 200.728,80	R\$ 418.907,40
TOTAL	R\$ 349.085,76	R\$ 903.279,60	R\$ 1.252.365,36

Quadro 9.

2.11 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	30/11/2021	31/12/2021	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.151.274.622,12	R\$ 4.307.596.258,07	83,8868%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 740.813.945,27	R\$ 750.235.130,45	14,6102%
TÍTULOS CVS	R\$ 8.852.863,68	R\$ 8.712.029,37	0,1697%
IMÓVEIS	R\$ 61.835.325,18	R\$ 68.293.435,00	1,3300%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 16.176.311,25	R\$ 173.785,24	0,0034%
TOTAL	R\$ 4.978.953.067,50	R\$ 5.135.010.638,13	100,00%

Quadro 10.

Nota: Registra-se que no mês de dezembro/2021 foram contabilizados os valores referentes a atualização dos imóveis de renda, com valorização de R\$ 6.458.109,82.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEWmZlx



2.12 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
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%
mai/21	R\$ 4.985.703.862,07	2,40%	3,70%	3,69%
jun/21	R\$ 5.049.248.442,12	1,27%	5,02%	4,38%
jul/21	R\$ 5.055.266.764,76	0,12%	5,14%	3,12%
ago/21	R\$ 5.028.755.971,61	-0,52%	4,59%	4,82%
set/21	R\$ 4.986.467.576,78	-0,84%	3,71%	7,20%
out/21	R\$ 4.928.789.222,04	-1,16%	2,51%	8,34%
nov/21	R\$ 4.978.953.067,50	1,02%	3,56%	5,92%
dez/21	R\$ 5.135.010.638,13	3,13%	6,80%	6,80%

Quadro 11.

2.13 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

1. Investimentos - Executivo

Saldo dos Investimentos em 12/2020		RS 4.808.000.009,11	
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
01/2021	RS 584.279,15	RS 82.104.432,44	RS -81.520.153,29
02/2021	RS 40.864.605,59	RS 44.974.382,51	RS -4.109.776,92
03/2021	RS 41.485.170,47	RS 10.665.619,53	RS 30.819.550,94
04/2021	RS 41.308.639,76	RS 10.074.221,86	RS 31.234.417,90
05/2021	RS 41.318.216,48	RS 14.353.928,89	RS 26.964.287,59
06/2021	RS 50.044.250,01	RS 10.611.950,64	RS 39.432.299,37
07/2021	RS 47.181.791,70	RS 9.896.860,10	RS 37.284.931,60
08/2021	RS 26.480.105,00	RS 11.394.062,81	RS 15.086.042,19
09/2021	RS 41.572.477,52	RS 10.674.589,38	RS 30.897.888,14
10/2021	RS 43.880.558,88	RS 10.627.718,85	RS 33.252.840,03
11/2021	RS 54.114.701,48	RS 14.772.501,88	RS 39.342.199,60
12/2021	RS 94.087.378,25	RS 11.974.925,91	RS 82.112.452,34
Saldo dos Investimentos em 12/2021		RS 5.135.010.638,13	

2. Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos - Executivo

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	10,0611 %	10,0611 %	0,7300 %
Juros	5,4500 %	5,4500 %	0,4432 %
Meta	16,0594 %	16,0594 %	1,1764 %
Rentabilidade em %	0,9536 %	0,9536 %	1,4852 %
Rentabilidade em R\$	RS 46.213.649,53	RS 46.213.649,53	RS 73.945.118,29
Resultado em %	-13,0155 %	-13,0155 %	+0,3051 %
Resultado em R\$	RS -731.506.030,76	RS -731.506.030,76	RS +15.370.857,46

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.



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					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 5.138.980,88	R\$ 5.181.412,73	(0,6612)	0,9059	0,8257	1,0664%	-0,1090%	-0,1090%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 90.312,37	R\$ 91.089,75	(0,3600)	1,6400	0,8600	2,1451%	4,5300%	4,5300%
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 2.014.068,02	R\$ 2.036.309,03	(2,4300)	3,1800	1,1000	1,7801%	4,8600%	4,8600%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FI RF LP	R\$ 75.779,65	R\$ 75.497,45	(3,8700)	4,4400	(0,3700)	0,0267%	-6,9600%	-6,9600%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 75.668,32	R\$ 75.590,14	(3,2300)	3,2400	(0,1000)	-0,1946%	-4,8600%	-4,8600%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 362.174,91	R\$ 364.732,60	(1,2527)	2,4291	0,7062	1,8603%	4,6456%	4,6456%
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ -	R\$ 165.527,34	-	-	0,3388	0,3388%	0,3388%	NC
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 7.756.984,15	R\$ 7.990.159,04						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 437.786,25	R\$ 441.840,95	(6,9600)	(2,1900)	0,9300	-8,1513%	-18,2600%	-18,2600%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 1.105.241,25	R\$ 1.097.665,91	(13,0596)	(6,7100)	(0,6854)	-19,4492%	-31,7869%	-31,7869%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT	R\$ 452.491,70	R\$ 478.650,33	(6,0249)	(0,5234)	5,7810	-1,1125%	-4,8165%	NC
OCCAM FIC FIA	R\$ 1.806.814,71	R\$ 1.869.922,31	(4,9000)	(2,6700)	3,4900	-4,2088%	-12,7400%	-12,7400%
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 107.239,32	R\$ 109.838,06	(13,2500)	(3,7300)	2,4200	-14,4647%	-22,5000%	-22,5000%
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 745.988,32	R\$ 786.452,84	7,5500	(0,5100)	5,4200	12,8010%	32,1100%	32,1100%
ITAÚ MM SP500 BRL FIC	R\$ 161.568,48	R\$ 170.527,33	7,6300	(0,5100)	5,5400	13,0134%	32,7400%	32,7400%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 4.817.130,03	R\$ 4.954.897,73						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 1.642.623,01	R\$ 1.699.304,75	8,5200	0,2100	3,4500	12,4997%	33,9200%	33,9200%
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.642.623,01	R\$ 1.699.304,75						
TOTAL GERAL	R\$ 14.216.737,19	R\$ 14.644.361,52						

Quadro 13.

Nota 1: Com base na Ata COMIV nº. 180/2021, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Aplicar no fundo BTG PACTUAL CP I FIC DE FI RF CP (: 14.171.644/0001-57), até o limite legal permitido.

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.520.893,95	R\$ 2.554.337,82	1,8145	1,5129	1,2916	4,6899%	17,6552%	17,6552%
TOTAL GERAL	R\$ 2.520.893,95	R\$ 2.554.337,82						

Quadro 14.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEWmZLx



3.3 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	30/11/2021	31/12/2021
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 7.756.984,15	R\$ 7.990.159,04
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 4.817.130,03	R\$ 4.954.897,73
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.642.623,01	R\$ 1.699.304,75
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.520.893,95	R\$ 2.554.337,82
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 16.555.960,29	R\$ 17.198.699,34

Quadro 15.

3.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

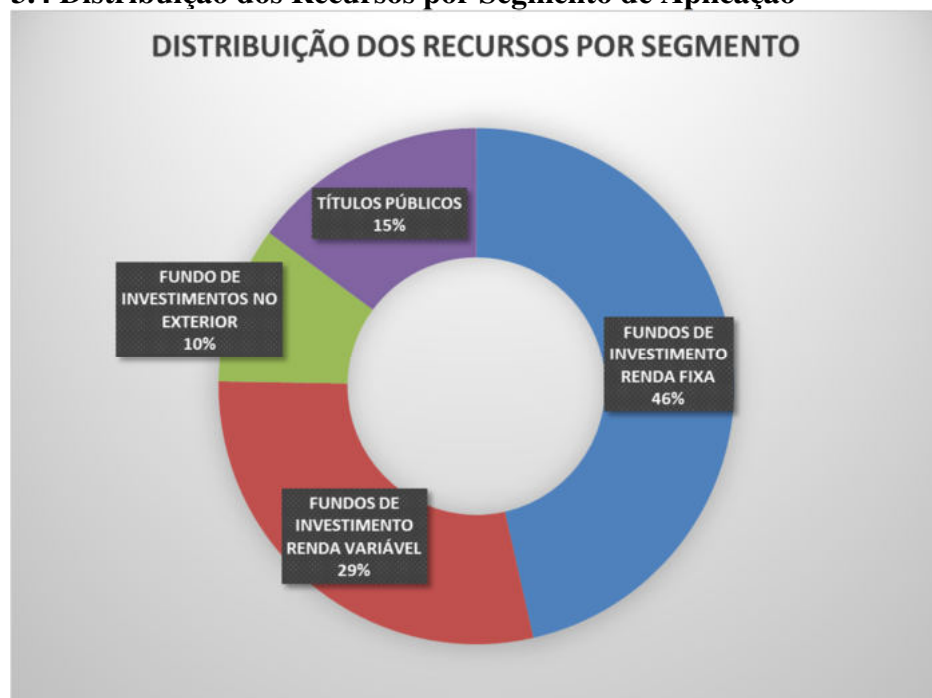


Gráfico 3.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEwMzIx



3.5 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

1. Investimentos - Assembléia

Saldo dos Investimentos em 12/2020			RS 15.166.901,59
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
01/2021	RS 286.790,86	RS 0,00	RS 286.790,86
02/2021	RS 143.097,24	RS 0,00	RS 143.097,24
03/2021	RS 143.973,76	RS 0,00	RS 143.973,76
04/2021	RS 144.001,52	RS 0,00	RS 144.001,52
05/2021	RS 144.070,46	RS 0,00	RS 144.070,46
06/2021	RS 144.136,78	RS 0,00	RS 144.136,78
07/2021	RS 174.168,74	RS 0,00	RS 174.168,74
08/2021	RS 152.615,42	RS 0,00	RS 152.615,42
09/2021	RS 152.252,38	RS 0,00	RS 152.252,38
10/2021	RS 165.653,56	RS 0,00	RS 165.653,56
11/2021	RS 169.762,40	RS 0,00	RS 169.762,40
12/2021	RS 164.966,52	RS 0,00	RS 164.966,52
Saldo dos Investimentos em 12/2021			RS 17.198.699,34

2. Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos - Assembléia

Taxa de Juros Anual	5,4500%	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	10,0611 %	10,0611 %	0,7300 %
Juros	5,4500 %	5,4500 %	0,4432 %
Meta	16,0594 %	16,0594 %	1,1764 %
Rentabilidade em %	0,2874 %	0,2874 %	1,7691 %
Rentabilidade em R\$	RS 46.308,11	RS 46.308,11	RS 296.101,68
Resultado em %	-13,5896 %	-13,5896 %	+0,5857 %
Resultado em R\$	RS -2.537.504,90	RS -2.537.504,90	RS +99.193,94

Quadro 16.

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

4.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	RS 7.616.402,95	RS 7.679.290,50	(0,6612)	0,9059	(0,8257)	-0,5890%	-0,1090%	-0,1090%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	RS 40.225.944,68	RS 40.540.838,53	(0,7200)	1,4500	0,7800	1,5052%	-0,1600%	-0,1600%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	RS 77.983.961,20	RS 78.696.812,90	(1,6263)	1,7339	0,9141	0,9942%	-0,3984%	-0,3984%
BB PREVID RF IDKA 2	RS 3.266.091,36	RS 3.289.156,56	(1,2527)	2,4291	0,7062	1,8603%	4,6456%	4,6456%
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	RS 1.651.313,10	RS 1.664.692,02	0,5800	0,6400	0,8100	2,0436%	4,9400%	4,9400%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FIA RF	RS 1.627.815,14	RS 1.626.133,37	(3,2300)	3,2400	(0,1000)	-0,1946%	-4,8600%	-4,8600%
TOTAL RENDA FIXA	RS 132.371.528,43	RS 133.496.923,88						
FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	RS 22.638.699,25	RS 23.288.292,57	(7,7600)	(3,5900)	2,8700	-8,5192%	-15,2800%	-15,2800%
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	RS 1.265.459,96	RS 1.296.125,92	(13,2500)	(3,7300)	2,4200	-14,4647%	-22,5000%	-22,5000%
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	RS 7.154.927,20	RS 7.543.030,69	7,5500	(0,5100)	5,4200	12,8010%	32,1100%	32,1100%
BB AÇÕES VALOR	RS 20.179.779,54	RS 21.002.458,48	(5,5414)	(0,8673)	4,0767	-2,5432%	-4,7614%	-4,7614%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	RS 51.238.865,95	RS 53.129.907,66						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	RS 8.151,70	RS 3.913.565,18						
TOTAL RECURSOS	RS 183.618.546,08	RS 190.540.396,72						

Quadro 17.



4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

1. Investimentos - Ministério Público

Saldo dos Investimentos em 12/2020		RS 169.242.211,10	
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
01/2021	RS 3.008.450,20	RS 8.065,16	RS 3.000.385,04
02/2021	RS 1.585.217,06	RS 1.642,15	RS 1.583.574,91
03/2021	RS 1.564.682,30	RS 17.772,47	RS 1.546.909,83
04/2021	RS 1.594.346,58	RS 9.707,31	RS 1.584.639,27
05/2021	RS 1.573.220,64	RS 41.257,15	RS 1.531.963,49
06/2021	RS 1.959.057,05	RS 12.521,07	RS 1.946.535,98
07/2021	RS 2.023.578,91	RS 55.617,86	RS 1.967.961,05
08/2021	RS 1.638.039,45	RS 23.802,84	RS 1.614.236,61
09/2021	RS 1.647.557,59	RS 3.779,70	RS 1.643.777,89
10/2021	RS 1.646.387,89	RS 23.802,84	RS 1.622.585,05
11/2021	RS 3.285.936,72	RS 81.114,00	RS 3.204.822,72
12/2021	RS 3.913.495,83	RS 32.084,33	RS 3.881.411,50
Saldo dos Investimentos em 12/2021		RS 190.540.396,72	

2. Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos - Ministério Público

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	10,0611 %	10,0611 %	0,7300 %
Juros	5,4500 %	5,4500 %	0,4432 %
Meta	16,0594 %	16,0594 %	1,1764 %
Rentabilidade em %	-2,1312 %	-2,1312 %	1,6558 %
Rentabilidade em RS	RS -3.830.617,72	RS -3.830.617,72	RS 3.040.439,14
Resultado em %	-15,6735 %	-15,6735 %	+0,4738 %
Resultado em RS	RS -32.647.074,45	RS -32.647.074,45	RS +880.282,08

Quadro 18.

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)				
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGIA	RS 7.773.369,25	RS 7.837.552,85	(0,6612)	0,9059	0,8257	1,0664%	-0,1090%	-0,1090%
BRADESCO INST. ALOC. DINAMICA	RS 8.574.531,11	RS 8.641.653,63	(0,7200)	1,4500	0,7800	1,5052%	-0,1600%	-0,1600%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	RS 9.496.445,81	RS 9.569.604,29	(1,2800)	2,4700	0,7700	1,9373%	3,6700%	3,6700%
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	RS 1.165.427,15	RS 1.174.869,42	0,5800	0,6400	0,8100	2,0436%	4,9400%	4,9400%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	RS 1.148.861,72	RS 1.147.674,78	(3,2300)	3,2400	(0,1000)	-0,1946%	-4,8600%	-4,8600%
BB PREVID RF IDKA 2	RS 2.079.189,88	RS 2.093.873,16	(1,2527)	2,4291	0,7062	1,8603%	4,6456%	4,6456%
TOTAL	RS 30.237.824,92	RS 30.465.228,13						

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)				
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	RS 850.905,58	RS 871.525,63	(13,2500)	(3,7300)	2,4200	-14,4647%	-22,5000%	-22,5000%
BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	RS 823.044,75	RS 846.661,14	(7,7600)	(3,5900)	2,8700	-8,5192%	-15,2800%	-15,2800%
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	RS 3.568.351,97	RS 3.761.909,47	7,5500	(0,5100)	5,4200	12,8010%	32,1100%	32,1100%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	RS 13.934,67	RS 14.740,24	(6,0249)	(0,5234)	5,7810	-1,1125%	-4,8165%	NC
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	RS -	RS 1.734.677,1400	-	-	(0,7200)	-0,7200%	-1,8900%	-1,8900%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	RS -	RS 1.734.806,6870	-	-	-	0,0000%	0,0000%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	RS 5.256.236,97	RS 8.964.320,31						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	RS 2.726,09	RS -
TOTAL RECURSOS	RS 35.496.787,98	RS 39.429.548,44

Quadro 19.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEWmZlx



Relatório de Investimentos – Dezembro/2021

018

Nota 1: Com base na Ata COMIV nº. 180/2021, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Aplicar no fundo GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA (38.280.883/0001-03).

Nota 2: Com base na Ata COMIV nº. 181/2021, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Direcionar para o fundo BTG PACTUAL S&P 500 BRL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (36.499.594/0001-74), respeitando os limites da legislação.

5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV

1. Investimentos - Defensoria

Saldo dos Investimentos em 12/2020		R\$ 25.328.013,69	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2021	RS 6.283,41	RS 77.294,71	RS -71.011,30
02/2021	RS 1.003.038,47	RS 51.465,27	RS 951.573,20
03/2021	RS 992.747,96	RS 51.465,27	RS 941.282,69
04/2021	RS 999.548,81	RS 39.463,54	RS 960.085,27
05/2021	RS 1.057.911,85	RS 96.855,31	RS 961.056,54
06/2021	RS 1.062.228,59	RS 51.465,27	RS 1.010.763,32
07/2021	RS 1.085.187,70	RS 51.462,27	RS 1.033.725,43
08/2021	RS 1.172.401,85	RS 51.465,27	RS 1.120.936,58
09/2021	RS 1.179.063,91	RS 12.001,73	RS 1.167.062,18
10/2021	RS 1.172.130,12	RS 51.465,27	RS 1.120.664,85
11/2021	RS 1.220.800,58	RS 90.180,34	RS 1.130.620,24
12/2021	RS 3.547.742,31	RS 80.855,04	RS 3.466.887,27
Saldo dos Investimentos em 12/2021		R\$ 39.429.548,44	

2. Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos - Defensoria

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	10,0611 %	10,0611 %	0,7300 %
Juros	5,4500 %	5,4500 %	0,4432 %
Meta	16,0594 %	16,0594 %	1,1764 %
Rentabilidade em %	1,0320 %	1,0320 %	1,3124 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 307.888,48	R\$ 307.888,48	R\$ 465.873,19
Resultado em %	-12,9480 %	-12,9480 %	+0,1344 %
Resultado em R\$	R\$ -4.461.600,01	R\$ -4.461.600,01	R\$ +48.275,74

Quadro 20.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEWMLzX



6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 162.612.742,86	R\$ 163.955.412,81	(0,6612)	0,9059	0,8257	1,0664%	-0,1090%	-0,1090%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 51.129.669,27	R\$ 51.597.045,77	(1,6263)	1,7339	0,9141	0,9942%	-0,3984%	-0,3984%
BB PREV RF IDKA 2	R\$ 170.104.422,44	R\$ 171.305.703,28	(1,2527)	2,4291	0,7062	1,8603%	4,6456%	4,6456%
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 1.559.379,57	R\$ 1.572.013,64	0,5800	0,6400	0,8100	2,0436%	4,9400%	4,9400%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 1.849.896,21	R\$ 1.847.985,00	(3,2300)	3,2400	(0,1000)	-0,1946%	-4,8600%	-4,8600%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 41.401.091,30	R\$ 41.360.457,88	(1,2800)	2,4700	0,7700	1,9373%	3,6700%	3,6700%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 428.657.201,65	R\$ 431.638.618,38						
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 2.762.118,40	R\$ 2.829.052,97	(13,2500)	(3,7300)	2,4200	-14,4647%	-22,5000%	-22,5000%
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 19.035.900,76	R\$ 20.068.461,87	7,5500	(0,5100)	5,4200	12,8010%	32,1100%	32,1100%
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 4.039.107,04	R\$ 4.155.004,91	(7,7600)	(3,5900)	2,8700	-8,5192%	-15,2800%	-15,2800%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 8.778.681,23	R\$ 9.286.178,35	(6,0249)	(0,5234)	5,7810	-1,1125%	-4,8165%	NC
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 2.959.907,11	-	-	(0,7200)	-0,7200%	-0,7200%	NC
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ -	R\$ 2.960.078,94	-	-	-	0,0000%	-3,7457%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 34.615.807,43	R\$ 42.258.684,15						
FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 30.436.642,75	R\$ 31.652.771,81	6,7610	(0,7968)	3,9956	10,1421%	32,3477%	32,3477%
TOTAL - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 30.436.642,75	R\$ 31.652.771,81						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 33.268,74	R\$ 1.268.056,82						
TOTAL	R\$ 493.742.920,57	R\$ 506.818.131,16						

Quadro 21.

Nota 1: Com base na Ata COMIV nº. 180/2021, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Aplicar no fundo GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA (38.280.883/0001-03).

Nota 2: Com base na Ata COMIV nº. 181/2021, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Direcionar para o fundo BTG PACTUAL S&P 500 BRL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (36.499.594/0001-74), respeitando os limites da legislação.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEWMLzLx



6.2 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

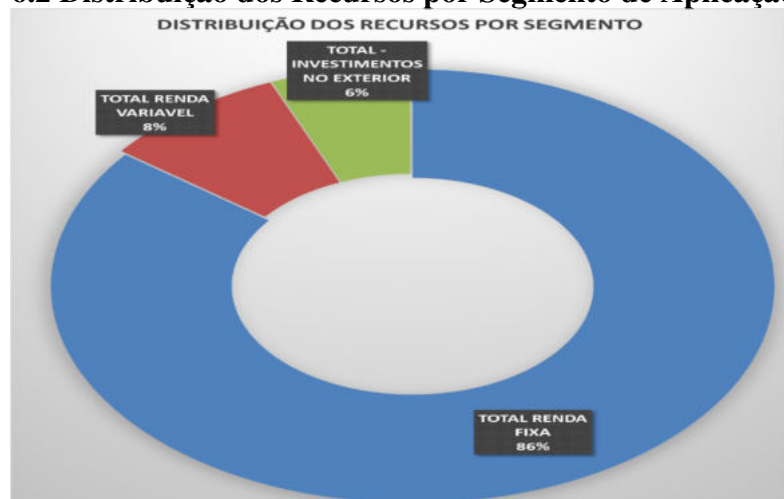


Gráfico 4.

6.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Justiça

Saldo dos Investimentos em 12/2020		R\$ 451.531.332,20	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2021	R\$ 3.459.800,94	R\$ 280.567,30	R\$ 3.179.233,64
02/2021	R\$ 3.471.253,44	R\$ 284.979,37	R\$ 3.186.274,07
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
05/2021	R\$ 3.591.371,99	R\$ 308.689,08	R\$ 3.282.682,91
06/2021	R\$ 3.620.988,47	R\$ 346.178,51	R\$ 3.274.809,96
07/2021	R\$ 3.670.676,51	R\$ 315.553,25	R\$ 3.355.123,26
08/2021	R\$ 3.690.680,27	R\$ 318.681,54	R\$ 3.371.998,73
09/2021	R\$ 3.738.023,51	R\$ 317.532,32	R\$ 3.420.491,19
10/2021	R\$ 3.756.511,37	R\$ 317.532,32	R\$ 3.438.979,05
11/2021	R\$ 3.805.215,10	R\$ 331.580,86	R\$ 3.473.634,24
12/2021	R\$ 7.253.729,28	R\$ 456.014,72	R\$ 6.797.714,56
Saldo dos Investimentos em 12/2021		R\$ 506.818.131,16	

2. Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos - Tribunal de Justiça

Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	10,0611 %	10,0611 %	0,7300 %
Juros	5,4500 %	5,4500 %	0,4432 %
Meta	16,0594 %	16,0594 %	1,1764 %
Rentabilidade em %	2,5975 %	2,5975 %	1,2714 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 12.189.613,43	R\$ 12.189.613,43	R\$ 6.277.496,03
Resultado em %	-11,5991 %	-11,5991 %	+0,0939 %
Resultado em R\$	R\$ -63.108.243,18	R\$ -63.108.243,18	R\$ +468.920,17

Quadro 22.



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 (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 41.674.722,09	R\$ 42.018.824,25	(0,6612)	0,9059	0,8257	1,0664%	-0,1090%	-0,1090%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 31.815.161,61	R\$ 32.039.840,92	(1,2527)	2,4291	0,7062	1,8603%	4,6456%	4,6456%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 21.229.616,44	R\$ 21.423.676,45	(1,6263)	1,7339	0,9141	0,9942%	-0,3984%	-0,3984%
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 301.989,72	R\$ 304.436,43	0,5800	0,6400	0,8100	2,0436%	4,9400%	4,9400%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 298.055,53	R\$ 297.747,60	(3,2300)	3,2400	(0,1000)	-0,1946%	-4,8600%	-4,8600%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 7.619.299,10	R\$ 7.677.996,48	(1,2800)	2,4700	0,7700	1,9373%	3,6700%	3,6700%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 102.938.844,49	R\$ 103.762.522,13						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 746.220,00	R\$ 764.303,19	(13,2500)	(3,7300)	2,4200	-14,4647%	-22,5000%	-22,5000%
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 3.551.602,97	R\$ 3.744.251,95	7,5500	(0,5100)	5,4200	12,8010%	32,1100%	32,1100%
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 429.565,78	R\$ 441.891,72	(7,7600)	(3,5900)	2,8700	-8,5192%	-15,2800%	-15,2800%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT.	R\$ 8.778.681,23	R\$ 9.286.178,35	(6,0249)	(0,5234)	5,7810	-1,1125%	-4,8165%	NC
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 859.592,91	-	-	(1,8900)	-1,8900%	-1,8900%	-1,8900%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ -	R\$ 859.642,80	-	-	-	0,0000%	1,8900%	0,0000%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 13.506.069,98	R\$ 15.955.860,92						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 582.119,38	R\$ 605.378,59	6,7610	(0,7968)	3,9956	10,1421%	32,3477%	32,3477%
TOTAL - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 582.119,38	R\$ 605.378,59						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 50.000,00	R\$ -						
TOTAL	R\$ 117.077.033,85	R\$ 120.323.761,64						

Quadro 23.

Nota 1: Com base na Ata COMIV nº. 180/2021, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Aplicar no fundo GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA (38.280.883/0001-03).

Nota 2: Com base na Ata COMIV nº. 181/2021, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Direcionar para o fundo BTG PACTUAL S&P 500 BRL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (36.499.594/0001-74), respeitando os limites da legislação.

7.2 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

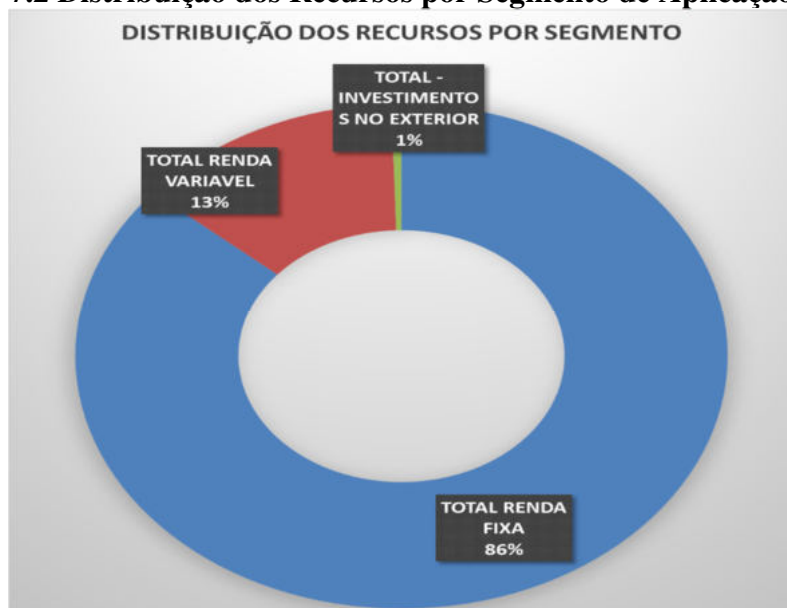


Gráfico 5.



7.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Contas

Saldo dos Investimentos em 12/2020		RS 111.881.662,84	
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
01/2021	RS 7.943,52	RS 0,00	RS 7.943,52
02/2021	RS 1.040.178,80	RS 0,00	RS 1.040.178,80
03/2021	RS 523.658,87	RS 0,00	RS 523.658,87
04/2021	RS 4.964,70	RS 0,00	RS 4.964,70
05/2021	RS 1.036.389,86	RS 67.687,34	RS 968.702,52
06/2021	RS 521.558,25	RS 32.206,97	RS 489.351,28
07/2021	RS 523.292,11	RS 39.670,93	RS 483.621,18
08/2021	RS 587.761,57	RS 32.116,97	RS 555.644,60
09/2021	RS 596.685,79	RS 32.206,97	RS 564.478,82
10/2021	RS 621.603,17	RS 7.463,96	RS 614.139,21
11/2021	RS 1.288.278,50	RS 56.027,71	RS 1.232.250,79
12/2021	RS 1.716.449,08	RS 39.670,93	RS 1.676.778,15
Saldo dos Investimentos em 12/2021		RS 120.323.761,64	

2. Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos - Tribunal de Contas

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	10,0611 %	10,0611 %	0,7300 %
Juros	5,4500 %	5,4500 %	0,4432 %
Meta	16,0594 %	16,0594 %	1,1764 %
Rentabilidade em %	0,2445 %	0,2445 %	1,3410 %
Rentabilidade em R\$	RS 280.386,36	RS 280.386,36	RS 1.569.949,64
Resultado em %	-13,6266 %	-13,6266 %	+0,1626 %
Resultado em R\$	RS -18.125.363,47	RS -18.125.363,47	RS +192.611,75

Quadro 24.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEwMzIx



8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV

1. Investimentos - CONSOLIDADO

Saldo dos Investimentos em 12/2020		R\$ 5.581.150.130,53	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
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\$ 45.312.469,30	R\$ 2.794.921,30
03/2021	R\$ 48.138.137,76	R\$ 11.102.576,72	R\$ 37.035.561,04
04/2021	R\$ 47.625.538,29	R\$ 10.441.370,66	R\$ 37.184.167,63
05/2021	R\$ 48.721.181,28	R\$ 14.868.417,77	R\$ 33.852.763,51
06/2021	R\$ 57.352.219,15	R\$ 11.054.322,46	R\$ 46.297.896,69
07/2021	R\$ 54.658.695,67	R\$ 10.359.164,41	R\$ 44.299.531,26
08/2021	R\$ 33.721.603,56	R\$ 11.820.129,43	R\$ 21.901.474,13
09/2021	R\$ 48.886.060,70	R\$ 11.040.110,10	R\$ 37.845.950,60
10/2021	R\$ 51.242.844,99	R\$ 11.027.983,24	R\$ 40.214.861,75
11/2021	R\$ 63.884.694,78	R\$ 15.331.404,79	R\$ 48.553.289,99
12/2021	R\$ 110.683.761,27	R\$ 12.583.550,93	R\$ 98.100.210,34
Saldo dos Investimentos em 12/2021		R\$ 6.009.321.175,43	

2. Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos - CONSOLIDADO

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	10,0611 %	10,0611 %	0,7300 %
Juros	5,4500 %	5,4500 %	0,4432 %
Meta	16,0594 %	16,0594 %	1,1764 %
Rentabilidade em %	0,9761 %	0,9761 %	1,4693 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 55.207.228,19	R\$ 55.207.228,19	R\$ 85.594.977,97
Resultado em %	-12,9962 %	-12,9962 %	+0,2894 %
Resultado em R\$	R\$ -852.385.816,77	R\$ -852.385.816,77	R\$ +17.060.141,14

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: Foram revisados os valores de **Receitas** e **Despesas**, com base nos Controles da GERAFF/COFIN, para o exercício de 2021.

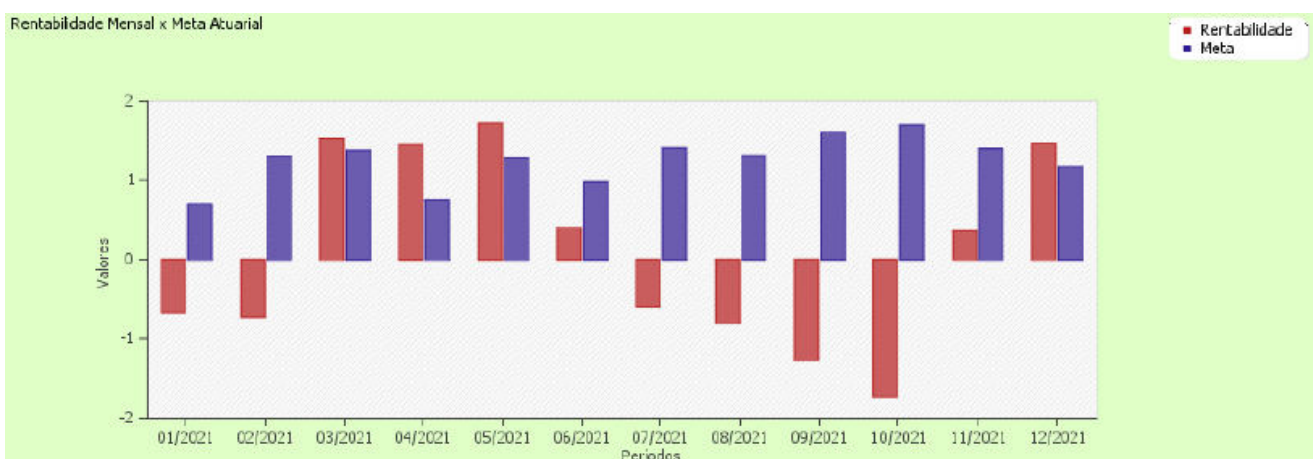


Gráfico 6.



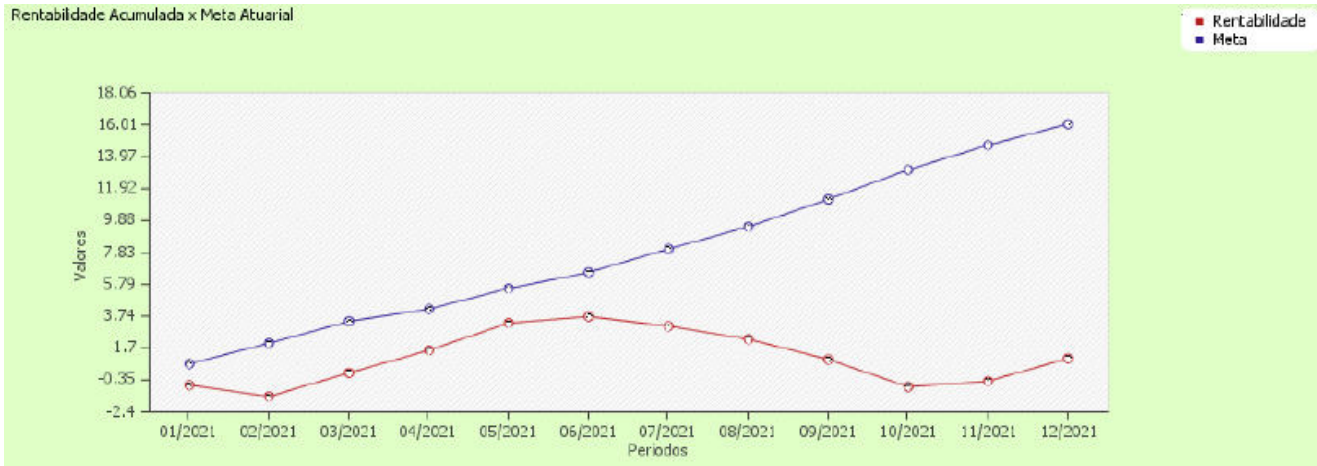


Gráfico 7.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEwMzIx



9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 11.753.073,29	R\$ 20.700.266,91
FUNDO BRADESCO RF - COMPREV	R\$ 6.054.723,75	R\$ 6.259.794,93
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 0,02	R\$ 0,02
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 27.382.766,13	R\$ 3.320.989,92
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 264.295,10	R\$ 264.295,10
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 23.432.002,70
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - COMPREV	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 45.454.859,29	R\$ 53.977.349,58

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 FPPM – Fundo de Proteção Previdenciária dos Militares

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R\$ 4.723,53	R\$ 24.930.709,80
BRADESCO DI PREMIUM - FPPM	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R\$ 1,00	R\$ 453,96
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ 24.806,63	R\$ 24.806,63
TOTAL	R\$ 29.531,16	R\$ 24.955.970,39

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	
	30/11/2021	31/12/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ 803.859,92
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ -	R\$ 803.859,92

Quadro 28.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEWmZlx



9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 449.391,24	R\$ 451.032,00
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 58.132,69	R\$ 2.075,62
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 179,35	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 507.703,28	R\$ 453.108,62

Quadro 29.

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 985.698,89	R\$ 3.172.933,30
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ 420.215,41	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 6.066.281,79
TOTAL	R\$ 1.405.914,30	R\$ 9.239.215,09

Quadro 30.

9.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 6.376.088,17	R\$ 12.279.664,11
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	R\$ 602.764,51	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 547.786,19
TOTAL	R\$ 6.978.853,68	R\$ 12.827.450,30

Quadro 31.

9.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.808.646,58	R\$ 6.709.308,76
DISPONIBILIDADE COBERTURA TCE FFIN	R\$ 1.946.837,55	R\$ 705,87
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 28.167,48	R\$ -
TOTAL	R\$ 4.783.651,61	R\$ 6.710.014,63

TOTAL GERAL FFIN	R\$ 59.160.513,32	R\$ 108.966.968,53
-------------------------	--------------------------	---------------------------

Quadro 32.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEwMzIx



10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 5.448.371,83	R\$ 1.143,62
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 45.106.086,68	R\$ 40.560.407,77
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 50.554.459,51	R\$ 40.561.552,39

Quadro 33.

10.2 Taxa de Administração - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 35.718,27
TOTAL	R\$ -	R\$ 35.718,27

Quadro 34.

10.3 Taxa de Administração - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 56.848,80	R\$ 61.970,46
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 56.848,80	R\$ 61.971,46

Quadro 35.

10.4 Taxa de Administração – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ 605.835,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 196.993,79	R\$ -
TOTAL	R\$ 196.993,79	R\$ 605.835,00

Quadro 36.

10.5 Taxa de Administração – PGJ/MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 74.213,96	R\$ 199.434,03
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 74.213,96	R\$ 199.434,03
TOTAL GERAL	R\$ 50.882.516,06	R\$ 41.464.511,15

Quadro 37.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEWMLzX



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 TESOUREO NACIONAL	R\$ 752.788.585,51	12,46%	10,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
TOTAL art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 752.788.585,51				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 7.120.337,67	33,89%	22,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 509.729.128,82				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 492.367.703,98				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 53.538.599,32				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 640.552.889,09				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 93.399.609,36				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 112.463.180,56				
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 138.946.928,62				
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 2.048.118.377,42				
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 70.456.237,12	10,58%	13,00%	40,00%	art. 7º, inciso IV, "a"
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 38.055.548,57				
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.608.058,65				
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 49.182.492,16				
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 422.765.060,34				
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 113.119,53				
TOTAL art. 7º, inciso IV, "a"	R\$ 639.180.516,37				
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 31.195.468,15	4,46%	3,00%	5,00%	art 7º, inciso VII, "b"
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 107.652.513,38				
ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 61.624.409,75				
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 35.021.379,46				
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 34.040.408,86				
TOTAL art 7º, inciso VII, "b"	R\$ 269.534.179,60				
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 3.709.621.658,90	61,38%			

Quadro 38.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEwMzIx



Relatório de Investimentos – Dezembro/2021

029

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	
BRDESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 28.731.850,34	0,48%	3,00%	30,00%	art 8º, inciso I, "a"
TOTAL art 8º, inciso I, "a"	R\$ 28.731.850,34				
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 38.807.964,00	23,64%	30,00%	30,00%	art. 8º, inciso II, "a"
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 76.459.160,97				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 122.788.669,99				
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 50.145.820,90				
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 8.130.314,94				
BRDESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 152.999.296,21				
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 46.984.364,62				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 228.949.493,23				
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 7.941.806,13				
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 31.063.490,15				
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 17.242.753,11				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 77.192.701,48				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 157.617.379,80				
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 34.095.419,66				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 104.186.789,94				
OCCAM FIC FIA	R\$ 82.731.675,55				
SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 12.327,77				
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 26.804.565,85				
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 97.670.543,70				
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 28.159.398,55				
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 38.984.655,51				
TOTAL art. 8º, inciso II, "a"	R\$ 1.428.968.592,06				
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 64.523.928,69	3,30%	3,00%	3,00%	art. 8º, inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 25.348.996,11				
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 109.828.928,93				
TOTAL art. 8º, inciso III	R\$ 199.701.853,73				
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 13.828.108,17	0,38%	2,00%	5,00%	art. 8º, inciso IV, "a"
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.256.195,85				
TOTAL art. 8º, inciso IV, "a"	R\$ 23.084.304,02				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.680.486.600,15	27,81%			

Quadro 39.

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\$ 58.238.540,61	5,30%	5,00%	10,00%	art 9º-A, inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 41.389.565,28				
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 34.417.308,95				
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 154.235.894,63				
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 32.233.514,06				
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 320.514.823,53				
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	R\$ 168.086.619,73	5,51%	5,00%		art 9º-A, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NÍVEL I	R\$ 164.986.079,35				
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 333.072.699,08				
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 653.587.522,61	10,81%			
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 6.043.695.781,66	100%			

Quadro 40.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO O NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEWmZLx



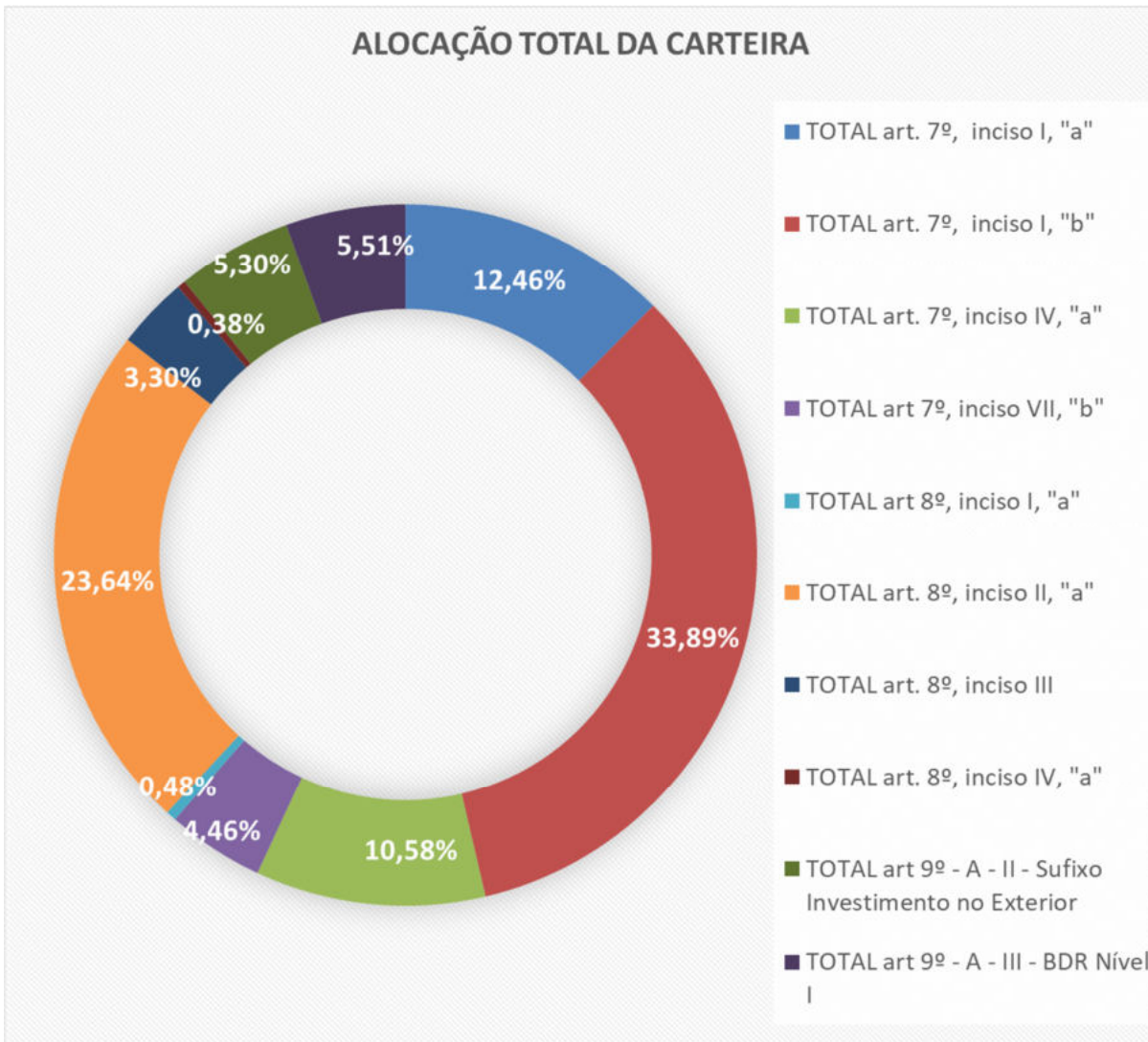


Gráfico 8.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEwMzIx



Relatório de Investimentos – Dezembro/2021

031

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% CARTEIRA	Resolução CMN n° 3.922/2010
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 38.807.964,00	0,63%	20%
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 76.459.160,97	1,24%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 168.086.619,73	2,73%	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 58.238.540,61	0,95%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 122.788.669,99	1,99%	
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 50.145.820,90	0,81%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 422.765.060,34	6,86%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 509.729.128,82	8,28%	
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 7.120.337,67	0,12%	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 8.130.314,94	0,13%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 49.182.492,16	0,80%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 38.055.548,57	0,62%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 152.999.296,21	2,48%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 28.731.850,34	0,47%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.608.058,65	0,95%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 70.456.237,12	1,14%	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 46.984.364,62	0,76%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 228.949.493,23	3,72%	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 13.828.108,17	0,22%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 7.941.806,13	0,13%	
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.256.195,85	0,15%	
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 35.021.379,46	0,57%	
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 25.348.996,11	0,41%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 53.538.599,32	0,87%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 492.367.703,98	7,99%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 640.552.889,09	10,40%	
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$ 31.063.490,15	0,50%	
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 107.652.513,38	1,75%	
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 17.242.753,11	0,28%	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 41.389.565,28	0,67%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 77.192.701,48	1,25%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 34.417.308,95	0,56%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 31.195.468,15	0,51%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 93.399.609,36	1,52%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 112.463.180,56	1,83%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 157.617.379,80	2,56%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 113.119,53	0,00%	
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 109.828.928,93	1,78%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 104.186.789,94	1,69%	
ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 61.624.409,75	1,00%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 34.095.419,66	0,55%	
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 34.040.408,86	0,55%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 82.731.675,55	1,34%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 164.986.079,35	2,68%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 138.946.928,62	2,26%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 64.523.928,69	1,05%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 154.235.894,63	2,50%	
SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 12.327,77	0,00%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 32.233.514,06	0,52%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 26.804.565,85	0,44%	
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 97.670.543,70	1,59%	
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 28.159.398,55	0,46%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 38.984.655,51	0,63%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO	R\$ 5.290.907.196,15		

Quadro 41.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEWmZlx



Relatório de Investimentos – Dezembro/2021

032

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	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL DO FUNDO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	R\$ 7.120.337,67	R\$ 248.037.532,98	2,87%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 509.729.128,82	R\$ 9.277.694.744,55	5,49%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 422.765.060,34	R\$ 7.701.081.218,58	5,49%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 122.788.669,99	R\$ 1.098.659.963,05	11,18%	
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 50.145.820,90	R\$ 1.417.181.864,81	3,54%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 168.086.619,73	R\$ 2.396.743.051,17	7,01%	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 58.238.540,61	R\$ 2.529.172.574,05	2,30%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 70.456.237,12	R\$ 631.584.812,26	11,16%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 38.055.548,57	R\$ 3.276.976.164,01	1,16%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.608.058,65	R\$ 1.241.205.562,42	4,72%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 49.182.492,16	R\$ 1.152.512.113,97	4,27%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 28.731.850,34	R\$ 503.177.927,29	5,71%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 152.999.296,21	R\$ 1.419.483.989,90	10,78%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 492.367.703,98	R\$ 12.444.051.491,75	3,96%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 53.538.599,32	R\$ 218.489.919,55	24,50%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 640.552.889,09	R\$ 12.561.638.596,69	5,10%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 113.119,53	R\$ 2.626.754.965,66	0,00%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESA FIC FIA	R\$ 34.095.419,66	R\$ 723.867.535,77	4,71%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 157.617.379,80	R\$ 2.631.453.374,95	5,99%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 104.186.789,94	R\$ 923.668.055,52	11,28%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 12.327,77	R\$ 166.923.439,39	0,01%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 154.235.894,63	R\$ 2.180.881.081,62	7,07%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 77.192.701,48	R\$ 999.787.061,37	7,72%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 93.399.609,36	R\$ 824.519.977,45	11,33%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 112.463.180,56	R\$ 604.309.300,74	18,61%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 138.946.928,62	R\$ 1.091.655.164,39	12,73%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 228.949.493,23	R\$ 1.896.702.011,80	12,07%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 164.986.079,35	R\$ 3.983.843.860,12	4,14%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 76.459.160,97	R\$ 1.900.035.039,47	4,02%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 82.731.675,55	R\$ 1.010.020.909,77	8,19%	
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 97.670.543,70	R\$ 1.094.729.532,50	8,92%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 26.804.565,85	R\$ 368.066.288,15	10,59%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 38.984.655,51	R\$ 542.903.933,54	5,72%	
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT	R\$ 31.063.490,15	R\$ 506.222.631,32	6,14%	
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 38.807.964,00	R\$ 873.571.747,14	4,44%	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 41.389.565,28	R\$ 135.056.267.739,99	0,03%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 34.417.308,95	R\$ 37.539.613.996,37	0,09%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 7.941.806,13	R\$ 87.352.824,95	9,09%	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 8.130.314,94	R\$ 205.904.381,47	3,95%	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 46.984.364,62	R\$ 476.428.583,05	9,86%	
DAYCOVAL IBOVESA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 17.242.753,11	R\$ 154.789.214,50	11,14%	
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 28.159.398,55	R\$ 703.850.641,65	4,00%	
SCHRODER SUSTENT ACOS GLOBAIS FIC FIA	R\$ 32.233.514,06	R\$ 19.919.461.267,17	0,16%	
TOTAL	R\$ 4.798.586.858,80			

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14, § 1º	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Resolução CMN nº 3.922/2010	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 64.523.928,69	R\$ 2.394.295.587,10	2,69%	5%	
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 109.828.928,93	R\$ 2.374.573.482,34	4,63%		
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 25.348.996,11	R\$ 385.338.764,40	6,58%		
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 13.828.108,17	R\$ 993.885.542,59	1,39%		
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.256.195,85	R\$ 186.152.675,59	4,97%		
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 35.021.379,46	R\$ 1.405.415.305,82	2,49%		
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 34.040.408,86	R\$ 777.989.992,71	4,38%		
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 107.652.513,38	R\$ 1.904.562.600,94	5,65%		
ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 61.624.409,75	R\$ 1.907.070.007,57	3,23%		
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 31.195.468,15	R\$ 1.086.649.624,61	2,87%		
TOTAL	R\$ 492.320.337,35				
TOTAL	R\$ 5.290.907.196,15				

Quadro 42.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEWmZLx



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 Icatu Vanguarda Inflação Longa FI RF (CNPJ: 10.756.541/0001-06);

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 NOVEMBRO/2021) EM R\$ MI	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (DEZEMBRO/2021)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB DTVM S.A	R\$ 1.439.434,96	R\$ 1.338.874.178,06	0,0930%	5%
CAIXA	R\$ 420.388,15	R\$ 1.217.522.682,54	0,2896%	
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 574.744,24	R\$ 467.466.047,61	0,0813%	
BANCO SAFRA	R\$ 105.879,73	R\$ 368.456.936,66	0,3480%	
BRADESCO	R\$ 550.350,66	R\$ 398.033.483,05	0,0723%	
ICATÚ VANGUARDA DTVM S/A	R\$ 34.408,75	R\$ 314.250.959,55	0,9133%	
BANCO BTG	R\$ 209.137,40	R\$ 320.345.978,95	0,1532%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	R\$ 305.005,20	R\$ 261.900.735,78	0,0859%	
VINCI PARTNERS	R\$ 42.469,53	R\$ 136.655.199,21	0,3218%	
OCCAM BRASIL GESTÃO	R\$ 14.652,83	R\$ 82.731.675,55	0,5646%	
PLURAL INVEST GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 35.871,89	R\$ 75.806.874,23	0,2113%	
AZ QUEST INVESTIMENTOS	R\$ 16.259,11	R\$ 76.459.160,97	0,4703%	
BC GESTAO RECURSOS LTDA	R\$ 7.191,10	R\$ 46.984.364,62	0,6534%	
ARX INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 35.272,51	R\$ 38.807.964,00	0,1100%	
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL LTDA	R\$ 23.109,64	R\$ 32.233.514,06	0,1395%	
MONGERAL AEGON	R\$ 8.602,73	R\$ 34.040.408,86	0,3957%	
SUL AMERICA INVESTIMENTOS	R\$ 28.481,18	R\$ 26.804.565,85	0,0941%	
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT ADM REC LTDA	R\$ 7.534,67	R\$ 17.242.753,11	0,2288%	
GUEPARDO INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 1.629,47	R\$ 28.159.398,55	1,7281%	
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	R\$ 56.771,92	R\$ 8.130.314,94	0,0143%	

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.



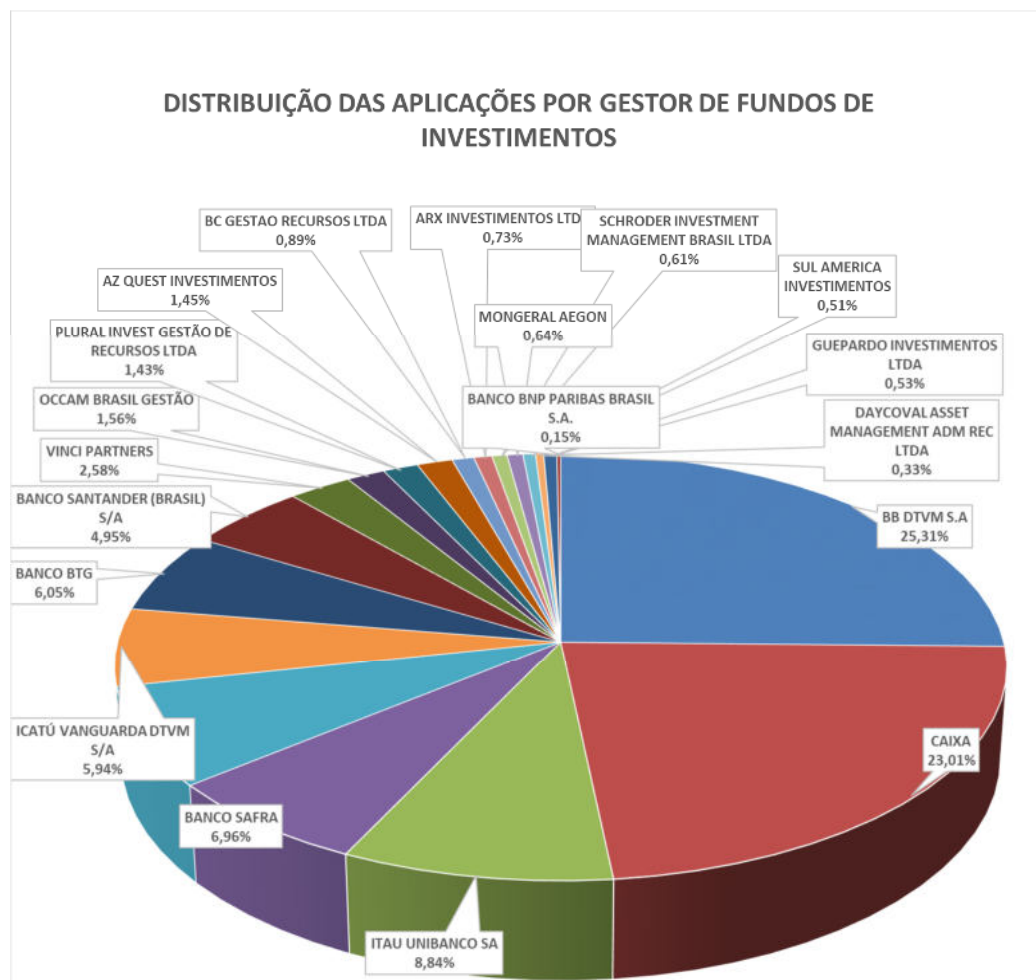


Gráfico 9.

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 5.290.907.196,15
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 752.788.585,51
TÍTULOS - CVS	R\$ 8.712.029,37
IMÓVEIS	R\$ 68.293.435,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 39.050.926,31
TOTAL	R\$ 6.159.752.172,34

Quadro 44.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEWMLzlx



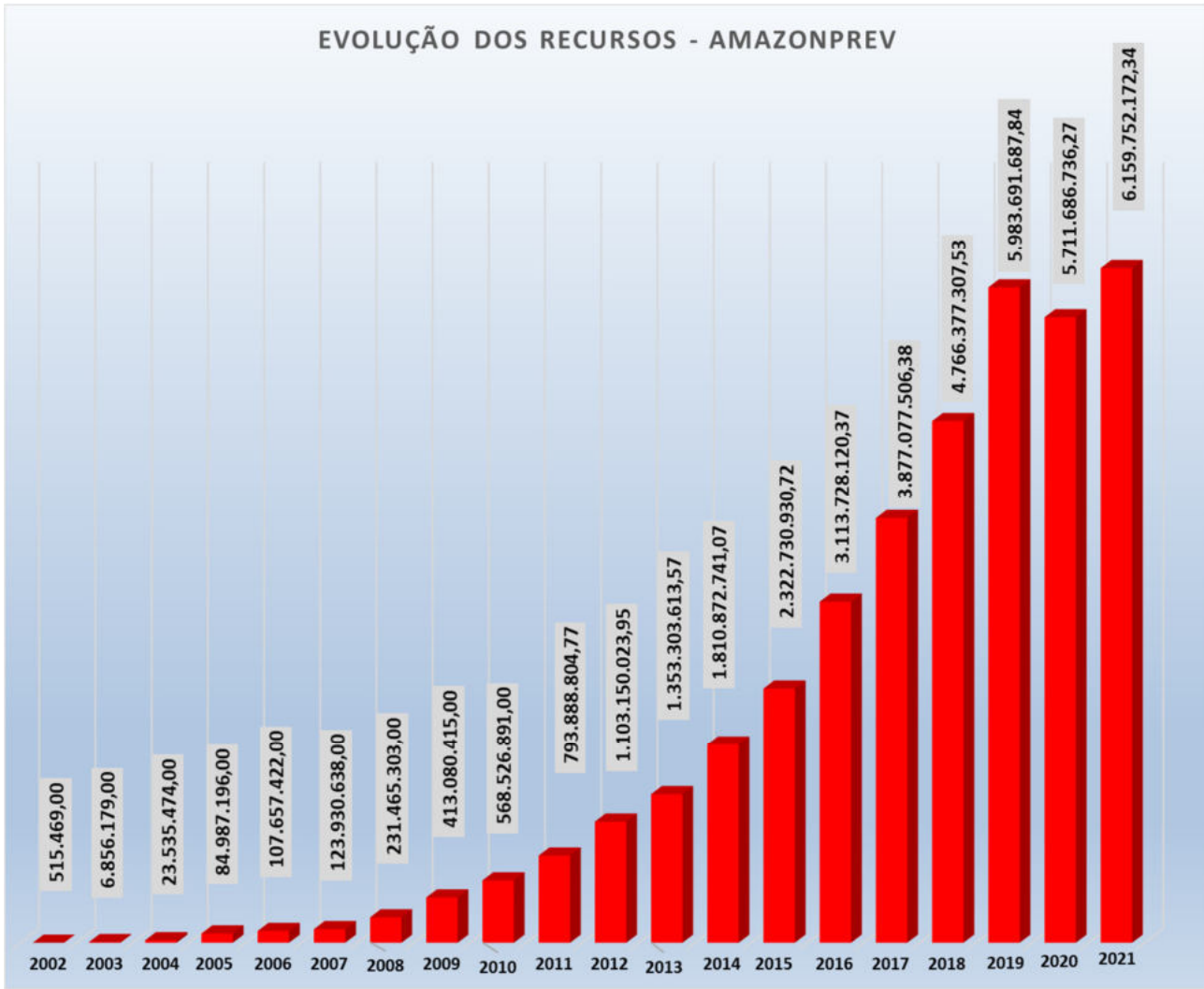


Gráfico 10.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEwMzIx



13. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV EXECUTIVO:	a) Novos Recursos: Ratear entre os fundos BTG PACTUAL S&P 500 BRL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (36.499.594/0001-74) e Itaú Private MM SP500 BRL FICFI (26.269.692/0001-61).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2021
	b) Recursos Atuais: 1.1. Resgatar R\$ 40 milhões do fundo Safra Consumo BDR (19.436.818/0001-80), direcionando para o fundo Constancia Fundamentos FIA (11.182.064/0001-77). 2. Resgatar R\$ 40 milhões do fundo BB ESG BDR (21.470.644/0001-13), direcionando para o fundo ITAÚ BDR NIVEL I AÇÕES (37.306.507/0001-88). 3. Resgatar R\$ 40 milhões do fundo Santander Global (17.804.792/0001-50), rateando entre os fundos: Tarpon GT 30 FIC FIA, Trigo Delphos Income (41.196.740/0001-22), OCCAM FIC FIA (11.628.883/0001-03) e GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA (38.280.883/0001-03). 4. Resgatar R\$ 30 milhões do fundo FI Caixa IMA B5, rateando entre os fundos Caixa Capital Protegido V e Rio Bravo Capital Protegido		
FPREV ALE:	a) Novos Recursos: Ratear entre os fundos BTG PACTUAL S&P 500 BRL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (36.499.594/0001-74) e Itaú Private MM SP500 BRL FICFI (26.269.692/0001-61).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2021
FPREV MPE/PGJ:	Novos Recursos: aplicar no fundo BTG PACTUAL S&P 500 BRL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (36.499.594/0001-74).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2021
	b) Recursos Atuais: Zerar posição no fundo Bradesco IBRX Alpha (14.099.976/0001-78), rateando os valores dos resgates entre os fundos: Tarpon GT 30 FIC FIA, Trigo Delphos Income (41.196.740/0001-22), OCCAM FIC FIA (11.628.883/0001-03) e GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA (38.280.883/0001-03).		
FPREV - DPE/AM	Novos Recursos: aplicar no fundo BTG PACTUAL S&P 500 BRL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (36.499.594/0001-74).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2021
	Novos Recursos: Zerar posição no fundo Bradesco IBRX Alpha (14.099.976/0001-78) direcionando para o fundo GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA.		
FPREV - TJ/AM	Novos Recursos: aplicar no fundo BTG PACTUAL S&P 500 BRL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (36.499.594/0001-74).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2021
	Recursos Atuais: Zerar posição no fundo Bradesco IBRX Alpha (14.099.976/0001-78), rateando os valores dos resgates entre os fundos: Tarpon GT 30 FIC FIA, Trigo Delphos Income (41.196.740/0001-22), OCCAM FIC FIA (11.628.883/0001-03) e GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA (38.280.883/0001-03).		
FPREV - TCE/AM	Novos Recursos: aplicar no fundo BTG PACTUAL S&P 500 BRL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (36.499.594/0001-74).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2021
	b) Recursos Atuais: Zerar posição no fundo Bradesco IBRX Alpha (14.099.976/0001-78) direcionando para o fundo GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA.		
FFIN (Executivo, ALE, TCE, TJA, MPE, DPE, FPPM)	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	15/02/2021
RECURSOS COMPREV	Aplicar os recursos no fundo Bradesco Maxi Poder Público.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2021
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	15/02/2021

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: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEwMzIx





AMAZONPREV
Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



RELATÓRIOS - 2021

RELATÓRIO DE RISCOS FPREV - AMAZONPREV

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEwMzIx



Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Relatório de Investimentos – Dezembro/2021

038

TOTAL RENDA FIXA	R\$	3.592.885.298,29
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$	1.661.420.852,88
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$	653.587.522,61
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$	5.907.893.673,78

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso I, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	dez/21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
TÍTULOS PÚBLICOS DO TESOURO	R\$ 743.334.839,23	R\$ 752.788.585,51							
TOTAL - art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 743.334.839,23	R\$ 752.788.585,51							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso I, "b"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	dez/21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Prev RF Tr Pub VII FI	R\$ 7.079.089,17	R\$ 7.120.337,67	0,20	1,62%	0,17%	-0,95	6,57%	0,58%	6,57%
Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	R\$ 53.088.094,00	R\$ 53.538.599,32	0,20	5,15%	0,53%	-1,01	-2,18%	0,85%	-2,18%
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	R\$ 488.617.878,32	R\$ 492.367.703,98	0,20	2,77%	0,29%	-2,29	4,31%	0,77%	4,31%
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	R\$ 595.078.999,88	R\$ 599.992.481,32	0,40	2,32%	0,24%	-1,00	-0,11%	0,83%	-0,11%
Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	R\$ 92.691.813,36	R\$ 93.399.609,36	0,25	2,81%	0,29%	-2,29	4,14%	0,76%	4,14%
Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	R\$ 112.883.548,91	R\$ 112.463.180,56	0,25	9,09%	0,94%	0,00	-6,96%	-0,37%	-6,96%
Safra Ima Institucional Fc FI RF	R\$ 136.099.023,98	R\$ 138.946.928,62	0,20	6,49%	0,67%	0,00	-4,86%	-0,10%	-4,86%
BB Prev RF Idka 2 FI	R\$ 506.154.654,50	R\$ 509.729.128,82	0,20	2,61%	0,27%	-2,26	4,65%	0,71%	4,65%
TOTAL - art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 1.991.693.102,12	R\$ 2.007.557.969,65							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso IV, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	dez/21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Prev RF Alocacao Ativa Fcfi	R\$ 468.639.244,19	R\$ 422.765.060,34	0,50	2,83%	0,29%	0,00	-0,40%	0,91%	-0,40%
Bradesco Fc FI RF Alocacao Dinamica	R\$ 48.800.475,79	R\$ 49.182.492,16	0,40	2,68%	0,28%	0,00	-0,16%	0,78%	-0,16%
Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	R\$ 58.516.836,21	R\$ 58.608.058,65	0,20	2,92%	0,30%	-2,32	3,67%	0,77%	3,67%
Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	R\$ 299.531,26	R\$ 75.287,33	0,20	0,14%	0,01%	0,00	4,21%	0,69%	4,21%
Itau Instit Alocacao Dinamica RF FICFI	R\$ 112.154,15	R\$ 113.119,53	0,40	1,10%	0,11%	-1,05	4,53%	0,86%	4,53%
Bradesco FI RF Ref DI Premium	R\$ 32.001.271,71	R\$ 32.260.545,52	0,20	0,16%	0,02%	0,00	4,94%	0,81%	4,94%
TOTAL - art. 7º, inciso IV, "a"	R\$ 608.369.513,31	R\$ 563.004.563,53							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso VII, "b"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	dez/21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	R\$ 30.854.744,78	R\$ 31.195.468,15	0,40	3,93%	0,41%	-3,99	4,86%	1,10%	4,86%
Mongeral Aegon Cred Priv FI RF LP	R\$ 25.973.110,33	R\$ 34.040.408,86	0,45	0,30%	0,03%	-0,06	6,29%	0,84%	6,29%
Sant RF Cred Priv Crescimento Inst FI LP	R\$ 99.044.974,59	R\$ 107.652.513,38	0,30	0,36%	0,04%	-0,05	5,99%	0,77%	5,99%
BTG Pact Cre Cor I FICFI RF Cred Priv	R\$ 7.702.655,51	R\$ 35.021.379,46	0,60	0,52%	0,05%	-0,10	8,16%	0,74%	8,16%
Itau High Grade RF Cred Priv FICFI	R\$ 53.345.940,97	R\$ 61.624.409,75	0,25	0,26%	0,03%	-0,03	5,16%	0,81%	5,16%
TOTAL - art. 7º, inciso VII, "b"	R\$ 216.921.426,18	R\$ 269.534.179,60							

Quadro 1.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEWmZlx



Relatório de Investimentos – Dezembro/2021

039

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso I, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	dez/21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	R\$ 27.930.416,82	R\$ 28.731.850,34	0,90	20,48%	2,11%	-10,90	-15,28%	2,87%	-15,28%
TOTAL - art. 8º, inciso I, "a"	R\$ 27.930.416,82	R\$ 28.731.850,34							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso II, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	dez/21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Ações Valor FICFIA	R\$ 117.978.963,89	R\$ 122.788.669,99	2,00	19,99%	2,06%	-15,12	-4,76%	4,08%	-4,76%
Bradesco FIA Mid Small Caps	R\$ 147.266.685,61	R\$ 152.999.296,21	1,50	22,55%	2,32%	-10,17	-9,84%	3,89%	-9,84%
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	R\$ 230.529.545,52	R\$ 228.949.493,23	3,00	23,83%	2,45%	-9,04	-31,79%	-0,69%	-31,79%
Caixa FIA Consumo	R\$ -	R\$ -	1,60	23,53%	2,42%	-10,57	-26,98%	-0,02%	-26,98%
Icatu Vanguardia Dividendos FIA	R\$ 76.484.317,50	R\$ 77.192.701,48	2,00	18,24%	1,88%	-9,60	-18,26%	0,93%	-18,26%
Itau Acoes Dunamis Fc	R\$ 156.101.613,81	R\$ 157.617.379,80	2,00	17,88%	1,84%	-6,97	-8,51%	0,97%	-8,51%
Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	R\$ 33.466.421,25	R\$ 34.095.419,66	2,50	20,30%	2,09%	-10,50	-16,64%	1,88%	-16,64%
Itau Institucional Acoes Phoenix Fc	R\$ -	R\$ -	2,00	22,41%	2,31%	-11,17	-17,09%	0,39%	-17,09%
Itau Small Cap Valuation Fc Acoes	R\$ 100.650.594,60	R\$ 104.186.789,94	2,00	23,55%	2,43%	-9,66	-10,06%	3,51%	-10,06%
Sant Seleoac Cresc Senior Acoes Fc FI	R\$ 12.064,20	R\$ 12.327,77	2,50	21,04%	2,16%	-12,22	-20,59%	2,18%	-20,59%
Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes	R\$ -	R\$ -	0,75	20,79%	2,14%	-11,97	-13,46%	2,86%	-13,46%
Sant Seleoac Crescimento Acoes Fc FI	R\$ -	R\$ -	2,00	21,03%	2,16%	-12,23	-20,54%	2,18%	-20,54%
Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	R\$ 74.798.444,07	R\$ 76.459.160,97	2,00	19,15%	1,97%	-10,73	-9,74%	2,22%	-9,74%
Occam Fc de FIA	R\$ 79.939.581,88	R\$ 82.731.675,55	2,50	20,06%	2,07%	-12,30	-12,74%	3,49%	-12,74%
Sul America Equities FIA	R\$ 25.543.886,19	R\$ 26.804.565,85	1,50	20,90%	2,15%	-11,50	-20,36%	4,94%	-20,36%
BTG Pactual Dividendos FIC FIA	R\$ 7.886.600,35	R\$ 7.941.806,13	2,50	19,11%	1,97%	-9,78	-19,00%	0,73%	-19,00%
Vinci Mosaico Institucional FIA	R\$ 97.551.401,37	R\$ 97.670.543,70	1,97	20,54%	2,12%	-10,27	-12,82%	0,73%	-12,82%
Vinci Selection Equities FIA	R\$ 34.255.367,85	R\$ 38.984.655,51	4,00	18,66%	1,92%	-10,60	-11,49%	2,66%	-11,49%
Brasil Capital Rp Inst Fc de FIA	R\$ 45.872.728,26	R\$ 46.984.364,62	3,12			-5,83		2,42%	
Bnpp Action Fc FIA	R\$ 7.836.757,83	R\$ 8.130.314,94	2,02	19,94%	2,05%	-11,80	-16,02%	3,75%	-16,02%
Daycoval Ibovespa Ativo FIA	R\$ 16.548.724,79	R\$ 17.242.753,11	3,50	21,49%	2,21%	-11,29	-18,36%	4,19%	-18,36%
Cx FIC FIA BR Acoes Livre Quantitativo	R\$ 11.342.056,59	R\$ 11.997.742,88	2,00	20,99%	2,16%	-7,51	5,61%	5,78%	5,61%
Guapardo Institucional FIC FIA	R\$ -	R\$ 28.159.398,55	2,05	25,04%	2,58%	-14,33	9,85%	-0,34%	9,85%
BB Acoes Quantitativo Fc	R\$ -	R\$ 50.145.820,90	2,00	19,59%	2,02%	-14,31	-6,26%	3,56%	-6,26%
ARX Income Inst Fc FIA	R\$ 37.533.248,57	R\$ 38.807.964,00	2,32	19,46%	2,00%	-10,58	-6,50%	3,40%	-6,50%
TOTAL - art. 8º, inciso II, "a"	R\$ 1.301.599.004,13	R\$ 1.409.902.844,79							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso III	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	dez/21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
Safra S P Reais Pb FI Mult	R\$ 61.204.048,00	R\$ 64.523.928,69	1,00	13,22%	1,36%	-5,08	32,11%	5,42%	32,11%
BTG Pactual S&P 500 Br FI Mult	R\$ -	R\$ 25.348.996,11	0,20	13,44%	1,39%	-5,10	33,76%	5,48%	33,76%
Itau Private Mult S&P500 Br Fc	R\$ 104.058.940,69	R\$ 109.828.928,93	0,80	13,38%	1,38%	-5,12	32,74%	5,54%	32,74%
TOTAL - art. 8º, inciso III	R\$ 165.262.988,69	R\$ 199.701.853,73							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso IV, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	dez/21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
BTG Pactual Economia Real FI Partic Mult	R\$ 13.877.804,75	R\$ 13.828.108,17	2,00			-5,90	13,62%	-0,36%	13,62%
BTG Pa Inv de Im FI Participac Mult CIA	R\$ 9.309.964,96	R\$ 9.256.195,85	2,15			0,00		-0,58%	
TOTAL - art. 8º, inciso IV, "a"	R\$ 23.187.769,71	R\$ 23.084.304,02							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	dez/21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Mult Global Select Equity Ie FI	R\$ 56.000.961,48	R\$ 58.238.540,61	0,08	17,65%	1,83%	-10,91	32,35%	4,00%	32,35%
Sant Global Equi Dolar Mas Mult Ie Fc FI	R\$ 152.880.147,40	R\$ 154.235.894,63	1,00	16,24%	1,68%	-11,57	23,65%	0,89%	23,65%
Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	R\$ 31.713.226,62	R\$ 32.233.514,06	1,00	17,38%	1,80%	-9,75	28,48%	1,64%	28,48%
Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	R\$ 39.539.540,73	R\$ 34.417.308,95	0,80	32,67%	3,36%	-24,25	5,29%	-12,95%	5,29%
Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	R\$ 39.523.473,43	R\$ 41.389.565,28	0,80	18,03%	1,86%	-10,58	23,24%	4,72%	23,24%
TOTAL - art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 319.657.349,66	R\$ 320.514.823,53							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	dez/21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Acoes Esg FIA - Bdr Nível I	R\$ 163.204.312,77	R\$ 168.086.619,73	0,50	17,23%	1,78%	-11,63	33,49%	2,99%	33,49%
Safra Consumo Americano FIA Bdr Nível I	R\$ 159.482.829,04	R\$ 164.986.079,35	1,50	17,50%	1,81%	-10,16	33,92%	3,45%	33,92%
TOTAL - TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 322.687.141,81	R\$ 333.072.699,08							

Quadro 2.

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

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEWmZlx



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.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEWmZLx



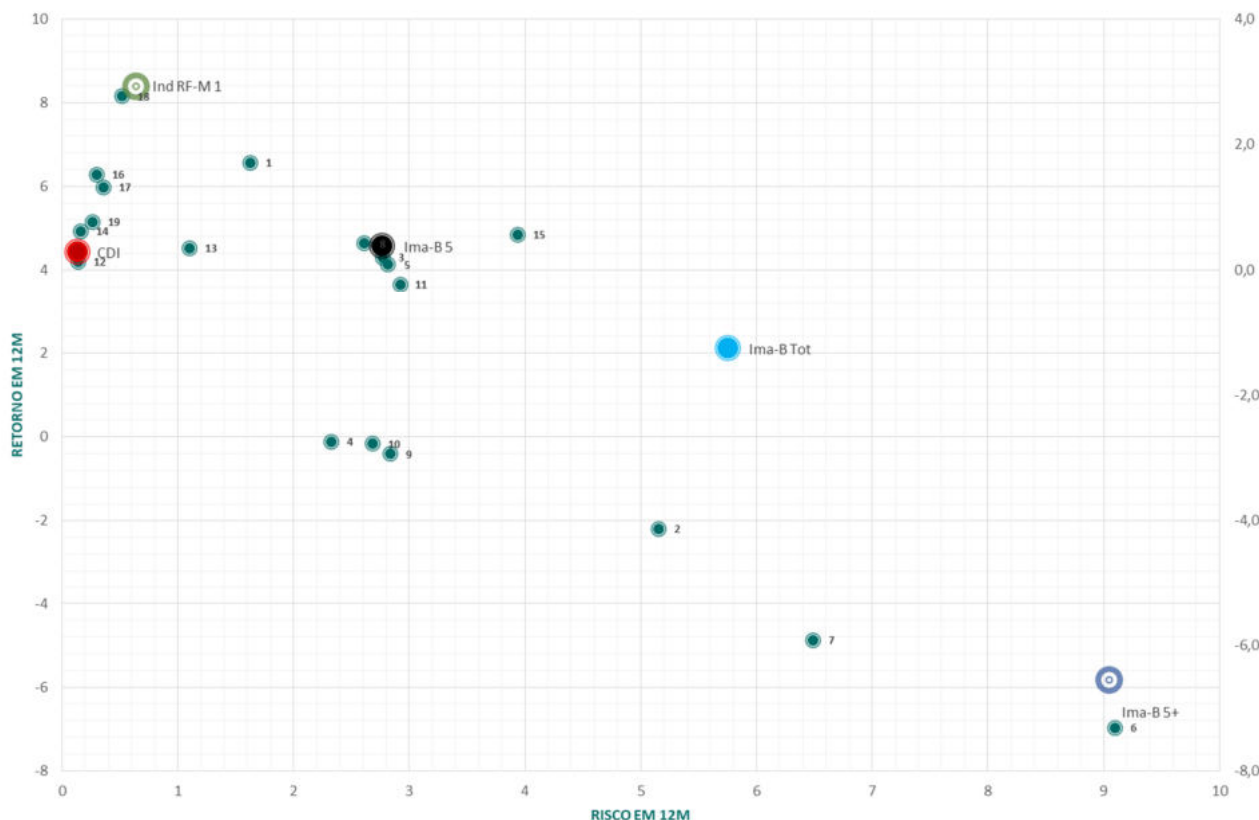


Gráfico 1: Art. 7º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art. 7º, inciso I, "b"	BB Prev RF Tit Publ VII FI	6,57	1,62	D+000	D+000
2	art. 7º, inciso I, "b"	Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	-2,18	5,15	D+000	D+000
3	art. 7º, inciso I, "b"	FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	4,31	2,77	D+000	D+000
4	art. 7º, inciso I, "b"	Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	-0,11	2,32	D+000	D+000
5	art. 7º, inciso I, "b"	Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	4,14	2,81	D+000	D+001
6	art. 7º, inciso I, "b"	Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	-6,96	9,09	D+000	D+001
7	art. 7º, inciso I, "b"	Safra Ima Institucional Fc FI RF	-4,86	6,49	D+003	D+004
8	art. 7º, inciso I, "b"	BB Prev RF Idka 2 FI	4,65	2,61	D+001	D+001
9	art. 7º, inciso IV, "a"	BB Prev RF Alocao Ativa Fcfi	-0,40	2,83	D+003	D+003
10	art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco Fc FI RF Alocao Dinamica	-0,16	2,68	D+003	D+004
11	art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	3,67	2,92	D+001	D+001
12	art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	4,21	0,14	D+000	D+000
13	art. 7º, inciso IV, "a"	Itau Instit Alocao Dinamica RF FICFI	4,53	1,10	D+000	D+001
14	art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco FI RF Ref DI Premium	4,94	0,16	D+000	D+000
15	art. 7º, inciso VII, "b"	Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	4,86	3,93	D+005	D+006
16	art. 7º, inciso VII, "b"	Mongeral Aegon Cred Priv FI RF LP	6,29	0,30	D+000	D+001
17	art. 7º, inciso VII, "b"	Sant RF Cred Priv Crescimento Inst FI LP	5,99	0,36	D+000	D+001
18	art. 7º, inciso VII, "b"	BTG Pact Cre Cor I FICFI RF Cred Priv	8,16	0,52	D+030	D+031
19	art. 7º, inciso VII, "b"	Itau High Grade RF Cred Priv FICFI	5,16	0,26	D+000	D+000

Quadro 2. Legenda Gráfico 1.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16

Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>

e valide o código: MTEwMzIx



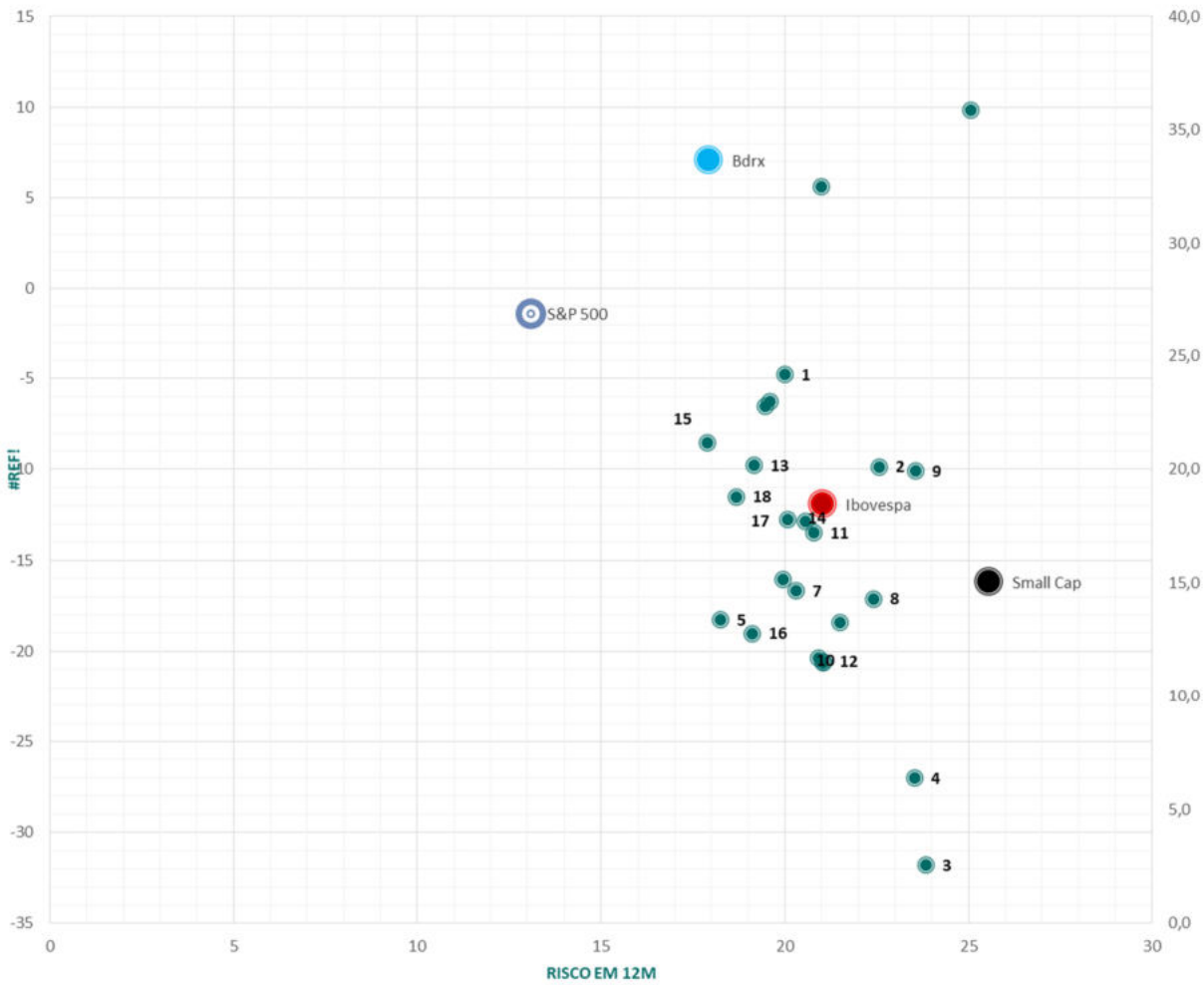


Gráfico 2: Art. 8º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEwMzIx



Relatório de Investimentos – Dezembro/2021

043

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art. 8º, inciso II, "a"	BB Ações Valor FICFIA	-4,76	19,99	D+030	D+032
2	art. 8º, inciso II, "a"	Bradesco FIA Mid Small Caps	-9,84	22,55	D+001	D+003
3	art. 8º, inciso II, "a"	BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	-31,79	23,83	D+001	D+032
4	art. 8º, inciso II, "a"	Caixa FIA Consumo	-26,98	23,53	D+001	D+003
5	art. 8º, inciso II, "a"	Icatu Vanguarda Dividendos FIA	-18,26	18,24	D+001	D+003
6	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Acoes Dunamis Fc	-8,51	17,88	D+021	D+023
7	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	-16,64	20,30	D+002	D+002
8	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Institucional Acoes Phoenix Fc	-17,09	22,41	D+021	D+023
9	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Small Cap Valuation Fc Acoes	-10,06	23,55	D+001	D+003
10	art. 8º, inciso II, "a"	Sant Selecao Cresc Senior Acoes Fc FI	-20,59	21,04	D+001	D+003
11	art. 8º, inciso II, "a"	Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes	-13,46	20,79	D+001	D+003
12	art. 8º, inciso II, "a"	Sant Selecao Crescimento Acoes Fc FI	-20,54	21,03	D+027	D+029
13	art. 8º, inciso II, "a"	Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	-9,74	19,15	D+027	D+029
14	art. 8º, inciso II, "a"	Occam Fc de FIA	-12,74	20,06	D+001	D+003
15	art. 8º, inciso II, "a"	Sul America Equities FIA	-20,36	20,90	D+001	D+003
16	art. 8º, inciso II, "a"	BTG Pactual Dividendos FIC FIA	-19,00	19,11	D+001	D+003
17	art. 8º, inciso II, "a"	Vinci Mosaico Institucional FIA	-12,82	20,54	D+001	D+003
18	art. 8º, inciso II, "a"	Vinci Selection Equities FIA	-11,49	18,66	D+060	D+062
19	art. 8º, inciso II, "a"	Brasil Capital Rp Inst Fc de FIA			D+030	D+032
20	art. 8º, inciso II, "a"	Bnpp Action Fc FIA	-16,02	19,94	D+027	D+029
21	art. 8º, inciso II, "a"	Daycoval Ibovespa Ativo FIA	-18,36	21,49	D+012	D+014
22	art. 8º, inciso II, "a"	Cx FIC FIA BR Acoes Livre Quantitativo	5,61	20,99	D+013	D+015
23	art. 8º, inciso II, "a"	ARX Income Inst Fc FIA	-6,50	19,46	D+001	D+003
24	art. 8º, inciso II, "a"	BB Acoes Quantitativo Fc	-6,26	19,59	D+001	D+003
25	art. 8º, inciso II, "a"	Guepardo Institucional FIC FIA	9,85	25,04	D+030	D+032

Quadro 3. Legenda Gráfico 2.

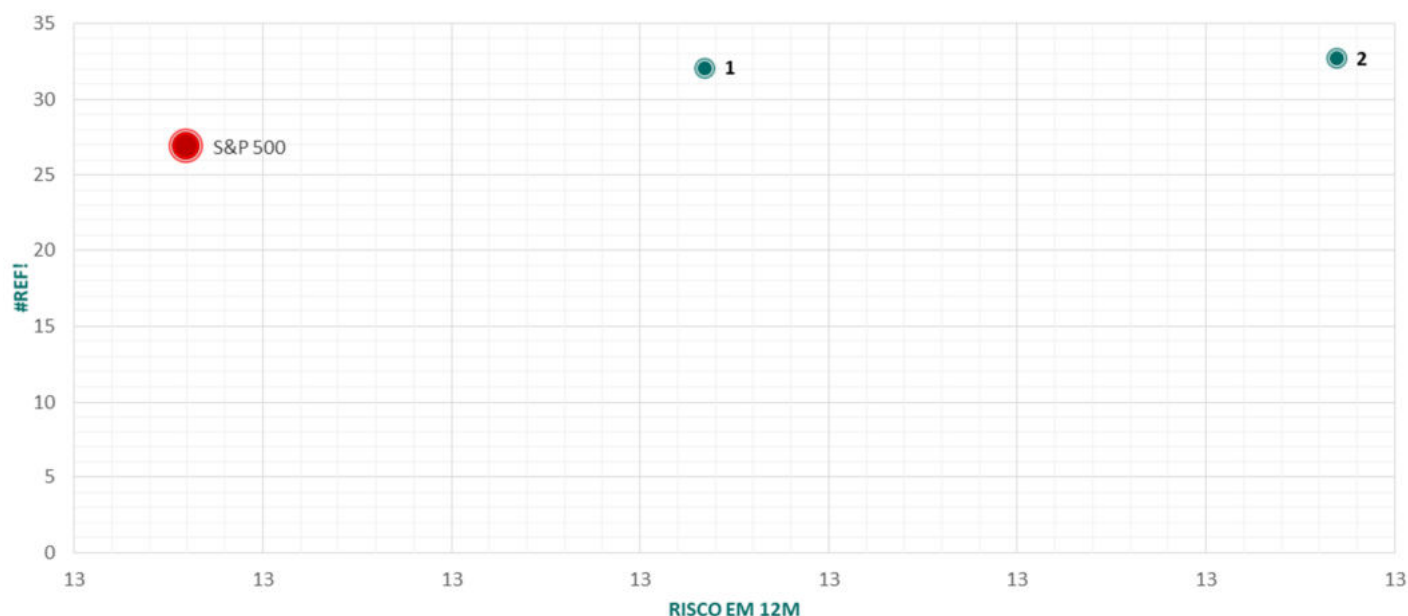


Gráfico 3: Art. 8-III,º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art. 8º, inciso III	Safra S P Reais Pb FI Mult	32,11	13,22	D+001	D+002
2	art. 8º, inciso III	Itau Private Mult S&P500 Brl Fc	32,74	13,38	D+000	D+001

Quadro 4. Legenda Gráfico 3.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEWmZLx



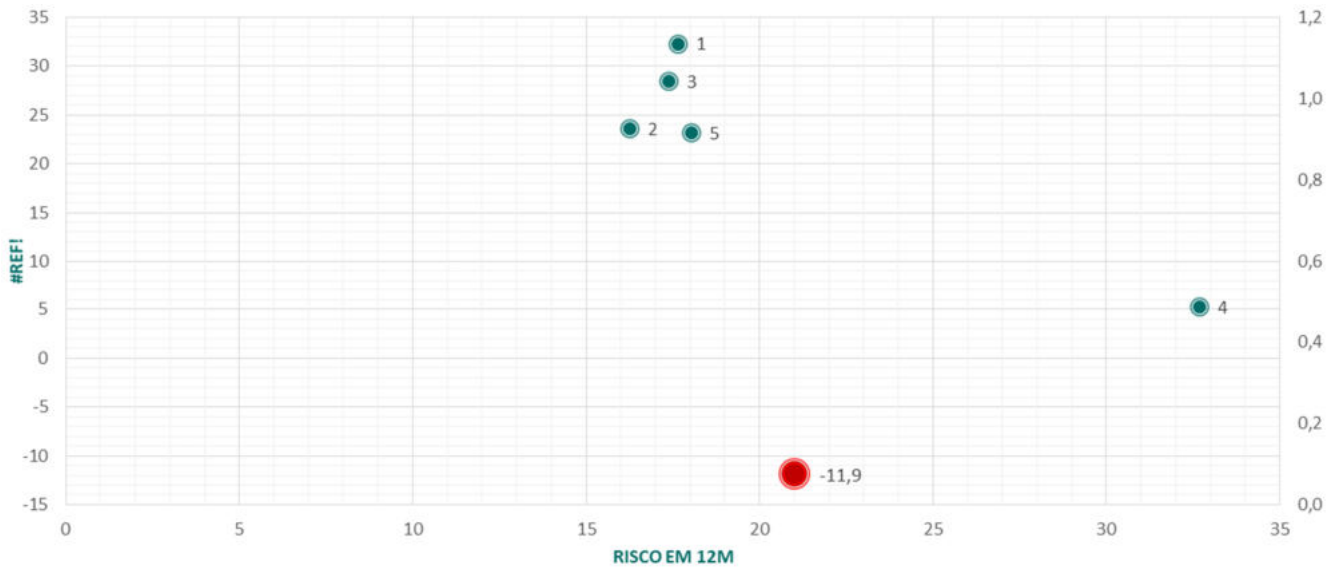


Gráfico 4: Art. 9º-A-II Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	BB Mult Global Select Equity Ie FI	32,35	17,65	D+001	D+005
2	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Sant Global Equi Dolar Mas Mult Ie Fc FI	23,65	16,24	D+001	D+008
3	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	28,48	17,38	D+001	D+004
4	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	5,29	32,67	D+001	D+006
5	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	23,24	18,03	D+001	D+006

Quadro 5. Legenda Gráfico 4.

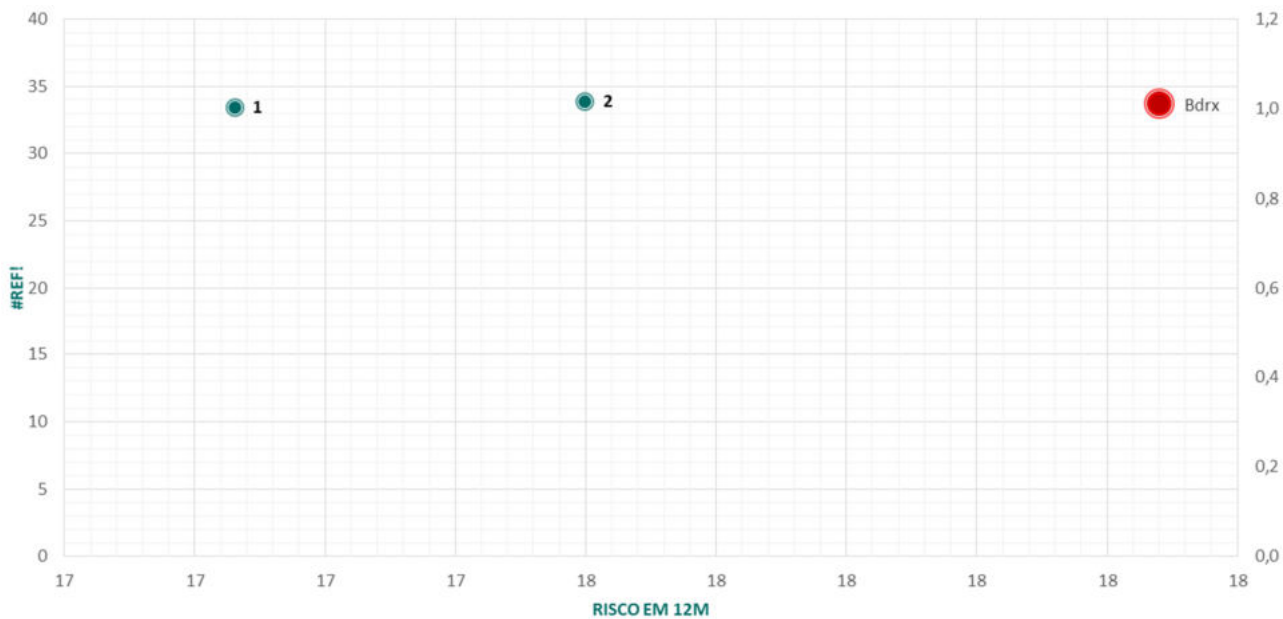


Gráfico 5: Art. 9-A-IIIº Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEwMzIx



Relatório de Investimentos – Dezembro/2021

045

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art 9º - A - III - BDR Nível I	BB Acoes Esg FIA - Bdr Nível I	33,49	17,23	D+001	D+004
2	art 9º - A - III - BDR Nível I	Safra Consumo Americano FIA Bdr Nível I	33,92	17,50	D+001	D+004

Quadro 6. Legenda Gráfico 5.

Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEwMzIx



PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 17 de janeiro de 2022, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de dezembro/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 janeiro de 2022.

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: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 20/01/2022 09:25:18
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/01/2022 09:52:47
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/01/2022 11:05:40

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/01/2022 14:57:32
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/01/2022 08:21:16
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/01/2022 08:31:10
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/01/2022 08:39:23
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/01/2022 08:59:32

Documento assinado eletronicamente 110351/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEWMLzLx

