

Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

Destino: DIRAF / PRESI

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

Data: 11/02/2020

RELATÓRIO Nº. /2020 – COMIV

Senhores Diretores,

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

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 03 a 04)
- 2) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Poder Executivo, apresentando os saldos e **performance** dos Fundos de Investimentos, evolução dos saldos dos Fundos de Investimentos, imóveis e CVS, comparativo da rentabilidade com a Meta Atuarial, Evolução e variação dos recursos do FPREV Executivo (páginas 05 a 10)
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 10 a 12)
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (página 12)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (página 13 a 14)
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (página 15)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (páginas 15 a 16)
- 8) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado – FPREV (página 17)
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro: Executivo, DPE, ALE e MPE – (páginas 18 a 19)
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 19)
- 11) Outros Recursos do Tribunal de Justiça – TJ/AM: Saldo e Composição (páginas 20)
- 12) Outros Recursos Tribunal de Contas do Estado - TCE: Saldo e Composição (página 20)
- 13) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 23 a 24)
- 14) Total consolidado e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 25 a 26)
- 15) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 27)
- 16) Relatório de Risco dos Ativos (páginas 28 a 32).
- 17) Verificação de Lastro dos Fundos de Risco de Crédito (página 33)
- 18) Parecer do Comitê de Investimentos (página 34).
- 19) Aprovação do Conselho Fiscal (página 35).

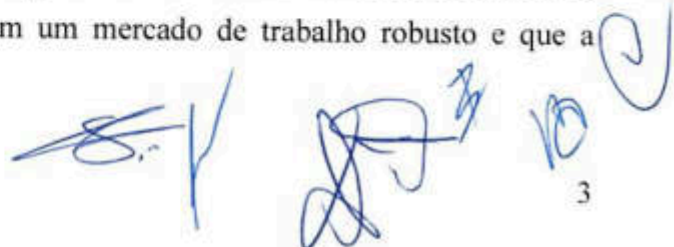


1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

Registrado pelo Relatório Síntese Econômica de Janeiro/2020, emitido pela BRAM Asset Management.

Os dados do ministério do trabalho (CAGED) mostraram a criação de 644 mil vagas formais em 2019. Na série com ajuste sazonal, segundo os nossos cálculos, o saldo de dezembro ficou positivo em 70 mil, mantendo a tendência positiva dos meses anteriores. Avalia-se que o cenário de recuperação gradual do emprego formal deverá continuar e estima-se que serão abertas cerca de 800 mil vagas formais em 2020. Os dados de atividade econômica frustraram as expectativas em novembro. O índice de atividade econômica do Banco Central (IBC-Br) avançou 0,2% no mês, acumulando crescimento de 1,1% em 12 meses. As vendas no varejo apresentaram queda de 0,5% no mês, abaixo do esperado. Já o setor de serviços recuou 0,1% no período. A produção industrial, por sua vez, teve retração de 1,2%, acima do esperado, com queda da produção de alimentos e veículos. O saldo de crédito teve expansão de 6,5% em 2019, acelerando em relação ao crescimento de 5% em 2018. O aumento nominal de 14,1% do saldo de crédito livre foi o principal responsável pelo desempenho mais forte em 2019. O cenário de recuperação consistente do mercado de crédito se mantém, diante do baixo nível da taxa de juros e do aumento da confiança, o que deve impulsionar os dados de atividade ao longo do ano. Em janeiro, a prévia da inflação ao consumidor (IPCA-15) desacelerou com o arrefecimento dos preços de alimentos. No mês, o IPCA-15 registrou alta de 0,71%. O grupo 'Alimentação no domicílio' teve variação de 2,3%, após registrar elevação de 4,7% no IPCA de dezembro. Destaque para a queda da inflação de carnes, que passou de +18,6% para +4,5% no período. Em 12 meses, a média dos núcleos totalizou alta de 3,2%. Avalia-se que a inflação deva seguir bem comportada, com alta de 3,5% em 2020, abaixo da meta do Banco Central (4,0%). O setor público consolidado terminou 2019 com o menor déficit desde 2014, impulsionado por fatores não recorrentes. O déficit primário fechou 2019 em R\$ 61,9 bilhões (0,85% do PIB). A dívida bruta caiu para 75,8% do PIB, 0,8 p.p. menor que 2018. Com o menor nível de receitas extraordinárias previstas para 2020, o resultado dependerá da arrecadação ligada à atividade e da continuidade do ajuste fiscal com as reformas estruturais dos gastos. Projetado déficit de 1,0% do PIB para 2020, acima do registrado em 2019. Emprego formal surpreende positivamente. Crédito segue em alta e inflação recua.

Nos EUA, o Fed manteve a taxa de juros em janeiro. A taxa de juros americana permaneceu no intervalo entre 1,50% e 1,75% ao ano na reunião de janeiro. Em seu comunicado, a autoridade monetária enfatizou que os dados recentes mostram um mercado de trabalho robusto e que a



Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

atividade segue crescendo em ritmo moderado. O presidente do Fed, Jerome Powell, novamente enfatizou que é preciso uma mudança material importante para que haja algum movimento de juros. Powell também afirmou que o cenário global ainda é de incerteza, embora reconheça que o acordo entre China e EUA tenha reduzido os riscos. O PIB americano do 4º trimestre manteve o mesmo ritmo de crescimento. O PIB teve alta de 2,1%, na margem, em termos anualizados, resultado equivalente ao registrado no 3º trimestre de 2019. Em linhas gerais, apesar da desaceleração esperada, o crescimento segue estável e próximo do potencial e a inflação segue comedida.

O Banco Central Europeu (BCE) manteve a política monetária estimulativa na reunião de janeiro, conforme o esperado. A taxa de depósito foi mantida em -0,5% a.a., a de refinanciamento em 0,0% e a taxa de empréstimo permaneceu em 0,25%. Além disso, não houve mudanças no programa de compra de ativos. Na entrevista após a reunião, a presidente do BCE, Christine Lagarde afirmou que os riscos para a atividade seguem baixistas, embora reconheça a redução da incerteza oriunda do acordo comercial entre EUA e China. Ademais, o BCE reforçou que deve revisar sua estratégia de política monetária ao longo de 2020. A postura do BCE deve se manter acomodatória até que os indicadores de atividade e inflação apontem uma recuperação consistente da região.

Na China, o PIB do 4º trimestre apresentou alta de 6,0%, e o coronavírus ameaça crescimento em 2020. O resultado para o PIB, em linha com a expectativa do mercado, foi impulsionado pelos indicadores de atividade de dezembro, que surpreenderam positivamente. No mês de janeiro, no entanto, a preocupação com a epidemia do coronavírus no país coloca em dúvida o potencial de crescimento. Apesar das incertezas que cercam o assunto, ao traçar um paralelo entre o coronavírus e o SARS, que afetou a economia chinesa em 2003, acredita-se que o maior impacto se concentrará no setor de serviços, com potencial de perda significativa no ritmo de crescimento no 1º trimestre. A questão reside na extensão do problema. Caso seja passageiro, como o SARS em 2003, será observada uma retomada nos meses seguintes de modo a não comprometer significativamente o crescimento no ano.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

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

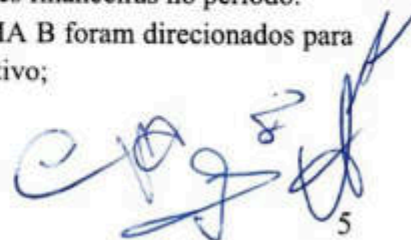
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)				
	31/12/2019	31/01/2020	nov/19	dez/19	jan/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 291.404.341,23	R\$ 951.811.398,87	(0,9380)	0,9588	0,4858	0,4977%	0,4858%	NC
BB PREVID TP VII	R\$ 19.830.095,05	R\$ 19.869.083,18	0,4337	0,9171	0,1966	1,5541%	0,1966%	9,2123%
BB PREVID IDKA 2	R\$ 779.347.656,84	R\$ -	-	-	-	0,0000%	0,0000%	0,0000%
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 198.018.545,52	R\$ 198.751.146,37	0,3332	0,3700	0,3700	1,0770%	0,3700%	5,6627%
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 61.017.937,22	R\$ 61.279.592,00	0,0066	0,8500	0,4288	1,2892%	0,4288%	NC
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 74.613.002,01	R\$ 75.029.425,42	(0,3896)	1,2300	0,5581	1,3984%	0,5581%	11,7852%
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 2.069.160,48	R\$ 2.177.557,56	0,3562	0,3500	0,3514	1,0614%	0,3514%	5,0743%
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF	R\$ 44.884.920,74	R\$ 44.868.865,68	0,8585	0,7800	(0,0358)	1,6089%	-0,0358%	7,4641%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 52.723.442,05	R\$ 53.144.822,25	(0,9967)	1,4900	0,7992	1,2815%	0,7992%	15,6548%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 786.165.139,76	R\$ 621.561.444,03	(0,3380)	1,2061	0,5441	1,4129%	0,5441%	11,7545%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 393.740.760,23	R\$ 396.966.681,83	(0,5077)	0,5934	0,8193	0,9027%	0,8193%	14,0965%
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 12.771.920,21	R\$ 12.893.149,56	(0,8602)	1,1600	0,9492	1,2418%	0,9492%	NC
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 54.105.864,09	R\$ 54.414.287,42	(0,3717)	1,2300	0,5700	1,4287%	0,5700%	NC
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 111.187.148,23	R\$ 111.209.977,41	(4,1408)	2,6000	0,0205	-1,6282%	0,0205%	NC
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 234.025.458,08	R\$ 234.822.926,47	0,3475	0,3400	0,3408	1,0318%	0,3408%	9,6887%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 65.173.881,43	R\$ 65.403.254,72	(2,4994)	2,2400	0,3519	0,0355%	0,3519%	NC
SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	R\$ 182.327.839,97	R\$ -	-	-	-	0,0000%	0,0000%	0,0000%
SANTANDER IMA B INST. TP	R\$ 23.898.291,44	R\$ -	-	-	-	0,0000%	0,0000%	0,0000%
SANTANDER RF ATIVO FIC	R\$ 16.944.002,80	R\$ 92.510.317,31	-	0,4033	0,3418	0,7465%	0,3418%	0,7465%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 3.404.249.407,38	R\$ 2.996.713.930,08						

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)				
	29/11/2019	31/12/2019	nov/19	dez/19	jan/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 53.488.335,31	R\$ 97.686.134,27	-	6,5217	(1,4392)	4,9886%	-1,4392%	NC
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 55.151.980,82	R\$ 83.954.695,82	-	10,4300	1,6141	12,2125%	1,6141%	NC
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPH	R\$ 33.172.203,65	R\$ 33.087.522,09	0,7310	7,4000	(0,2553)	7,9089%	-0,2553%	NC
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 67.233.626,38	R\$ 222.360.991,89	0,2449	7,1900	2,0318	9,6358%	2,0318%	31,9989%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 5.388.337,85	R\$ 99.002.501,64	3,3085	8,2221	3,3830	15,5850%	3,3830%	47,8043%
CADXA FIC CAPITAL PROTEGIDO	R\$ 5.641.186,09	R\$ -	-	-	-	0,0000%	0,0000%	0,0000%
ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FI	R\$ 26.693.759,15	R\$ 26.280.760,34	-	7,2800	(1,5472)	5,6202%	-1,5472%	5,6202%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 270.514.941,75	R\$ 272.194.807,54	0,4561	7,5100	0,6210	8,6710%	0,6210%	27,7605%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 181.100.233,57	R\$ 180.758.123,74	1,9002	8,1300	(0,1889)	9,9765%	-0,1889%	NC
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 69.231.592,11	R\$ 10.512.308,42	1,3002	8,2700	0,6759	10,4190%	0,6759%	23,7393%
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 162.109.478,81	R\$ 164.487.751,26	2,9990	10,2100	1,4671	15,1806%	1,4671%	31,0319%
ITAU SMALL CAPS VALUATION	R\$ -	R\$ 57.227.707,88	-	-	(4,6205)	-4,6205%	-4,6205%	NC
SAFRA S&P REAIS	R\$ 19.241.920,34	R\$ 19.313.414,95	3,7849	2,6300	0,3716	6,9102%	0,3716%	23,1333%
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 77.237.719,42	R\$ 76.728.076,02	1,3765	7,8126	(0,6598)	8,5754%	-0,6598%	21,3522%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 33.754.891,18	R\$ 109.399.964,55	1,4955	7,6335	(0,4094)	8,7959%	-0,4094%	NC
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$ -	R\$ 51.644.933,73	-	-	(2,5108)	-2,5108%	-2,5108%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.059.960.206,43	R\$ 1.504.639.694,13						
TOTAL GERAL	R\$ 4.464.209.613,81	R\$ 4.501.353.624,21						

Quadro 1.

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

Nota 2: Os recursos aplicados nos fundos Santander IMA B5 e Santander IMA B foram direcionados para os fundos Santander Ibovespa Ativo, Santander Seleção 30 e Santander RF Ativo;



Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

Nota 3: Os recursos aplicados no fundo BB Previdenciário IDKA 2 foram direcionados para os fundos BB PREV Ações Valor, BB PREV RF Alocação e BTG PACTUAL Absoluto INST FIQ FIA;

Nota 4: Direcionado recurso do Itau FOF RPI Ações para o fundo Itaú Small Cap Valuation.

2.2 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXECUTIVO

INSTITUIÇÃO	nov/19	dez/19	jan/20
BRADESCO	R\$ 386.832.397,01	R\$ 424.042.829,70	R\$ 454.279.939,27
BANCO DO BRASIL	R\$ 1.108.802.838,59	R\$ 1.144.070.428,43	R\$ 1.069.366.616,33
CAIXA	R\$ 1.256.495.095,42	R\$ 1.288.543.786,72	R\$ 1.215.544.315,43
ITAÚ	R\$ 612.251.823,27	R\$ 646.466.762,57	R\$ 648.287.136,78
SANTANDER	R\$ 306.572.404,51	R\$ 334.162.744,81	R\$ 330.283.291,60
ICATU/BEM DTVM	R\$ 450.937.124,45	R\$ 475.273.633,43	R\$ 476.992.982,29
SAFRA	R\$ 82.670.999,03	R\$ 84.415.801,77	R\$ 84.716.669,65
BTG PACTUAL	R\$ 62.723.302,30	R\$ 67.233.626,38	R\$ 222.360.991,89
TOTAL	R\$ 4.267.285.984,58	R\$ 4.464.209.613,81	R\$ 4.501.831.943,24

Quadro 2.

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - JANEIRO - 2020

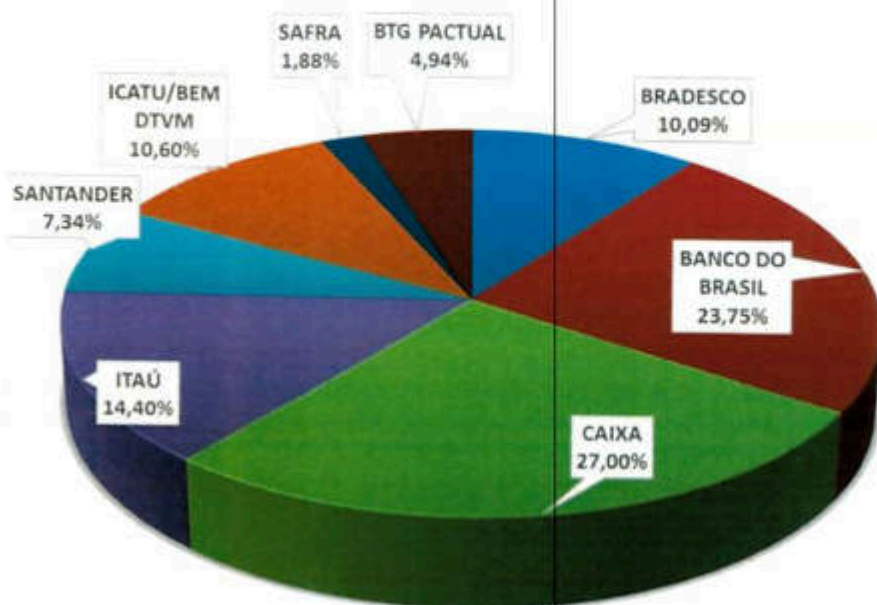


Gráfico 1

2.3 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA

FUNDO DE INVESTIMENTO	ÍNDICE DE REFERÊNCIA	SALDO APLICADO	% APLICADO
BRADESCO FI REFER DI PREMIUM BRADESCO FI MAXI PODER PUBLICO	CDI	R\$ 200.928.703,93	4,46%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA BB PREVID ALOCAÇÃO ATIVA SAFRA CONSUMO AMERICANO SAFRA S&P REAIS BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI SANTANDER RF ATIVO FIC	CDI ATIVO	R\$ 1.756.704.331,43	39,03%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF SANTANDER IMA B INST. TP	IMA B	R\$ 65.403.254,72	1,45%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5 CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP ICATU VANG. FI RF INFLA. CP ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	IMA B 5	R\$ 763.898.306,43	16,97%
BB PREVID IDKA 2 TP RF	IDKA 2	R\$ -	0,00%
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF BB PREVID RF IMA B5+	IMA B 5+	R\$ 111.209.977,41	2,47%
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF BB PREVID TP VII BB PREVID TP IX	IPCA + 6%	R\$ 117.882.771,11	2,62%
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FI	IBR X	R\$ 59.368.282,43	1,32%
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA BRADESCO FIA MID SMALL CAPS ITAÚ SMALL CAPS VALUATION CAIXA CONSUMO FI AÇÕES ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES BTG ABSOLUTO FIQ FIA SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES SANTANDER SELEÇÃO 30	IBOVESPA	R\$ 1.425.957.996,75	31,68%
TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO		R\$ 4.501.353.624,21	100%

Quadro 3

DISTRIBUIÇÃO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA - AMAZONPREV

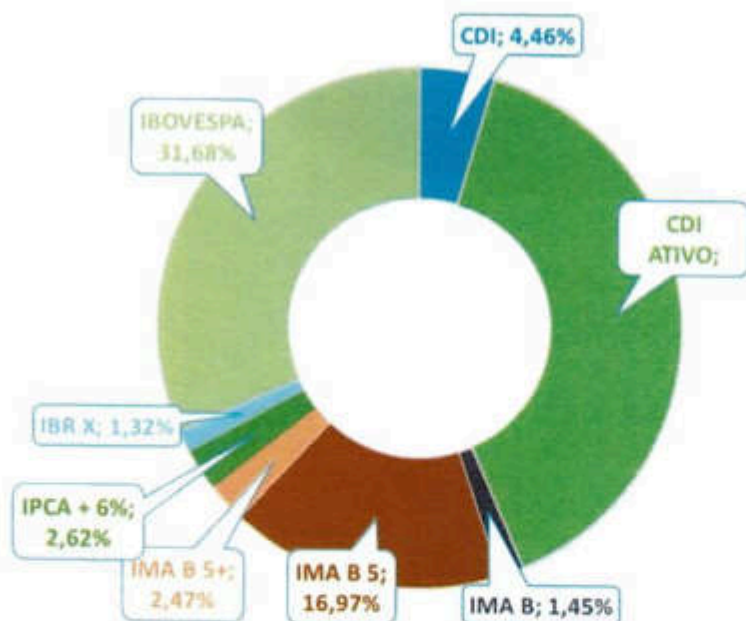


Gráfico 2.

[Handwritten signature and scribbles]

Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2019	31/01/2020	nov/19	dez/19	jan/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 152.499.743,65	R\$ 153.621.680,85	1,037272	1,680629	0,735698	3,4912%	0,73570	10,9433%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 158.569.619,48	R\$ 159.751.181,43	1,046740	1,690157	0,745138	3,5203%	0,74514	11,0681%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 161.880.612,44	R\$ 163.125.069,49	1,070423	1,713991	0,768750	3,5931%	0,76875	11,3809%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 164.274.775,25	R\$ 165.498.874,34	1,046756	1,690173	0,745153	3,5203%	0,74515	11,0683%
TOTAL GERAL	R\$ 637.224.750,82	R\$ 641.996.806,11						

Quadro 5.

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

2.6 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
TIPO DE ATIVO	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B
INTERMEDIÁRIO	BRDESCO	BRDESCO	BRDESCO	BRDESCO
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\$ 153.621.680,85	R\$ 159.751.181,43	R\$ 163.125.069,49	R\$ 165.498.874,34
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 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	31/12/2019	31/01/2020
CVS - A	R\$ 1.466.892,62	R\$ 1.449.439,30
CVS - B	R\$ 9.491.736,10	R\$ 9.378.758,30
CVS - C	R\$ 190.288,28	R\$ 188.024,20
CVS - D	R\$ 1.040.895,24	R\$ 1.028.505,72
TOTAL	R\$ 12.189.812,24	R\$ 12.044.727,52

Quadro 7.

2.8 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/20	R\$ 35.286,77	R\$ 145.084,72	R\$ 180.371,49
TOTAL	R\$ 35.286,77	R\$ 145.084,72	R\$ 180.371,49

Quadro 8.

Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

2.9 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2020 (Contrato Regular)			
MÊS	UEA	SEAS	TOTAL
jan/20			R\$ -
TOTAL	RS -	RS -	RS -

Quadro 9.

2.10 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	31/12/2019	31/01/2020	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	RS 4.464.209.613,81	RS 4.501.353.624,21	86,3030%
TÍTULOS PÚBLICOS	RS 637.224.750,82	RS 641.996.806,11	12,3088%
TÍTULOS CVS	RS 12.189.812,24	RS 12.044.727,52	0,2309%
IMÓVEIS	RS 60.353.005,55	RS 60.353.005,55	1,1571%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	RS -	RS 5.790,46	0,0001%
TOTAL	RS 5.173.977.182,42	RS 5.215.753.953,85	100,0000%

Quadro 10.

2.11 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS – FPREV EXECUTIVO

Mês	Recursos FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
fev/19	R\$ 4.198.622.173,30	1,30%	3,61%	20,77%
mar/19	R\$ 4.270.610.204,33	1,71%	5,39%	20,79%
abr/19	R\$ 4.340.813.251,38	1,64%	7,12%	21,39%
mai/19	R\$ 4.441.433.234,67	2,32%	9,60%	24,70%
jun/19	R\$ 4.560.478.660,06	2,68%	12,54%	26,72%
jul/19	R\$ 4.650.607.110,06	1,98%	14,77%	25,75%
ago/19	R\$ 4.698.765.985,21	1,04%	15,96%	25,85%
set/19	R\$ 4.814.401.867,02	2,46%	18,81%	26,83%
out/19	R\$ 4.927.631.461,93	2,35%	21,60%	26,59%
nov/19	R\$ 4.968.291.263,50	0,83%	22,61%	26,14%
dez/19	R\$ 5.173.977.182,42	4,14%	27,68%	27,68%
jan/20	R\$ 5.215.753.953,85	0,81%	0,81%	24,54%

Quadro 11.

Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

2.12 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Município de Governo Amazonas / AM - EXECUTIVO2020

12/02/2020 17:00:28

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 31/01/2020	
		Saldo Financeiro em 31/01/2019	4.144.928.828,18
Mês/Ano	Receitas RS	Despesas RS	Resultado RS
02/2019	36.105.221,68	1.577.166,50	34.528.055,18
03/2019	48.780.707,02	1.653.421,67	47.127.285,35
04/2019	27.254.847,98	1.484.969,43	25.769.878,55
05/2019	37.682.513,87	1.872.658,21	35.809.855,66
06/2019	41.150.382,45	1.842.441,88	39.307.940,57
07/2019	38.725.793,39	2.036.530,69	36.689.262,70
08/2019	39.885.991,44	1.920.723,93	37.965.267,51
09/2019	41.301.229,85	1.811.278,88	39.489.950,97
10/2019	40.858.104,23	2.023.186,58	38.834.917,65
11/2019	40.805.162,75	889.103,33	39.916.059,42
12/2019	80.878.067,28	1.824.810,55	79.053.256,73
01/2020	31.251.496,04	2.054.191,64	29.197.304,40
		Saldo Financeiro em 31/01/2020	5.215.753.953,85
Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos			
Taxa de Juros Anual:	5,8800 %	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	4,1917 %	0,2100 %	0,2100 %
Juros	5,8800 %	0,4773 %	0,4773 %
Meta	10,3181 %	0,6883 %	0,6883 %
Rentabilidade %	13,5056 %	0,2431 %	0,2431 %
Rentabilidade RS	587.136.090,98	12.579.467,03	12.579.467,03
Resultado %	+2,8893 %	-0,4421 %	-0,4421 %
Resultado RS	+138.456.582,34	-23.031.596,06	-23.031.596,06

Quadro 12.

Nota: Os valores de **Receitas** representam os valores de Contribuições Previdenciárias (ativos, aposentados e pensionistas), já as **Despesas** referem-se aos valores de Folha de Pagamento (aposentados e pensionistas).

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO						
	31/12/2019	31/01/2020	nov/19	dez/19	jan/20	TRIMESTRE	2020	ULTIMOS 12 MESES	
CAIXA FIA CONSUMO	RS -	RS 243.401,22	-	-	(2.6395)	-2,6395%	-2,6395%	NC	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	RS 4.771.519,61	RS 4.560.457,17	(0,5077)	0,5934	0,8193	0,9027%	0,8193%	14,0965%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	RS 4.622.073,10	RS 4.637.823,36	0,3475	0,3400	0,3408	1,0318%	0,3408%	NC	
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	RS 596.903,95	RS 600.610,65	0,4561	7,5100	0,6210	8,6710%	0,6210%	NC	
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	RS 235.230,61	RS 469.695,56	-	1,1600	0,9492	2,1202%	0,9492%	NC	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	RS -	RS -							
TOTAL	RS 10.225.727,27	RS 10.511.987,97							

Quadro 13.

Nota: Conforme Ata 156/2019-COMIV, a Diretoria aprovou ratear os novos recursos entre os fundos Caixa Gestão Estratégica, Caixa Consumo, Itaú Alocação Dinâmica, Icatu Vanguarda Inflação Crédito Privado.

Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/01/2019	30/01/2020	nov/19	dez/19	jan/20	TRIMESTRE	2019	ULTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.165.347,82	R\$ 2.181.482,63	1,046740	1,690157	0,745138	3,5203%	0,7451%	11,0681%
TOTAL GERAL	R\$ 2.165.347,82	R\$ 2.181.482,63						

Quadro 14

3.3 Composição dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS - ALE FPREV	out/19	nov/19	dez/19	jan/20
SALDO ANTERIOR	11.774.465,04	12.017.646,25	12.150.767,48	12.391.075,09
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	117.675,84	116.604,44	116.605,44	232.286,40
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	125.505,37	16.516,79	123.702,17	70.109,10
SAÍDAS FINANCEIRAS	-	-	-	-
SALDO FINAL	12.017.646,25	12.150.767,48	12.391.075,09	12.693.470,59

Quadro 15

3.4 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	31/12/2019	31/01/2020
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 10.225.727,27	R\$ 10.511.987,97
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.165.347,82	R\$ 2.181.482,63
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 12.391.075,09	R\$ 12.693.470,60

Quadro 16

3.5 Evolução dos Recursos – ALE/FPREV

Mês	Recursos ALE FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
jan/19	R\$ 10.037.031,39	4,01%	4,01%	28,94%
fev/19	R\$ 10.201.534,98	1,64%	5,71%	28,95%
mar/19	R\$ 10.372.018,29	1,67%	7,48%	28,87%
abr/19	R\$ 11.181.920,91	7,81%	15,87%	35,97%
mai/19	R\$ 10.907.257,42	-2,46%	13,02%	33,82%
jun/19	R\$ 11.207.199,38	2,75%	16,13%	35,83%
jul/19	R\$ 11.373.542,16	1,48%	17,85%	33,46%
ago/19	R\$ 11.456.007,59	0,73%	18,71%	32,37%
set/19	R\$ 11.774.465,04	2,78%	22,01%	30,94%
out/19	R\$ 12.017.646,25	2,07%	24,53%	33,35%
nov/19	R\$ 12.150.767,48	1,11%	25,91%	32,09%
dez/19	R\$ 12.391.075,09	1,98%	28,40%	28,40%
jan/20	R\$ 12.693.470,60	2,44%	2,44%	26,47%

Quadro 17

Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

3.6 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Município de Governo Amazonas / AM - ASSEMBLEIA2020

12/02/2020 16:21:31

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 31/01/2020		
		Saldo Financeiro em 31/01/2019		10.037.031,39
Mês/Ano	Receitas RS	Despesas RS	Resultado RS	
02/2019	108.995,36	0,00	108.995,36	
03/2019	108.995,35	0,00	108.995,35	
04/2019	118.011,62	0,00	118.011,62	
05/2019	115.170,24	0,00	115.170,24	
06/2019	114.154,91	0,00	114.154,91	
07/2019	0,00	0,00	0,00	
08/2019	116.326,93	0,00	116.326,93	
09/2019	115.124,97	0,00	115.124,97	
10/2019	117.675,84	0,00	117.675,84	
11/2019	116.604,44	0,00	116.604,44	
12/2019	116.912,84	0,00	116.912,84	
01/2020	232.286,40	0,00	232.286,40	
		Saldo Financeiro em 31/01/2020		12.693.470,60
Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos				
Taxa de Juros Anual:	5,8800 %	Índice de Inflação:	IPCA	
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês	
IPCA	4,1917 %	0,2100 %	0,2100 %	
Juros	5,8800 %	0,4773 %	0,4773 %	
Meta	10,3181 %	0,6883 %	0,6883 %	
Rentabilidade %	12,0466 %	0,5658 %	0,5658 %	
Rentabilidade RS	1.276.180,31	70.109,11	70.109,11	
Resultado %	+1,5668 %	-0,1216 %	-0,1216 %	
Resultado RS	+182.944,89	-15.175,25	-15.175,25	

Quadro 18

Nota: Os valores de **Receitas** representam os valores de Contribuições Previdenciárias (ativos, aposentados e pensionistas), já as **Despesas** referem-se aos valores de Folha de Pagamento (aposentados e pensionistas).

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/12/2019	31/01/2020	nov/19	dez/19	jan/20	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 47.830.964,32	R\$ 50.749.468,54	(0,9463)	0,8500	0,4288	0,3240%	0,4288%	NC	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+	R\$ 13.024.126,05	R\$ 13.030.298,77	(4,1025)	2,7212	0,0474	-1,4462%	0,0474%	NC	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 81.598.729,42	R\$ 81.912.874,73	0,2081	1,1526	0,3850	1,7533%	0,3850%	NC	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 3.118,26	R\$ -							
TOTAL	RS 142.456.938,05	RS 145.692.642,04							

Quadro 19

Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Município de Governo Amazonas / AM - PGJMP2020

12/02/2020 17:02:28

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 31/01/2020		
		Saldo Financeiro em 31/01/2019		99.882.866,83
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$		Resultado R\$
02/2019	0,00			0,00
03/2019	0,00			0,00
04/2019	0,00			0,00
05/2019	0,00			0,00
06/2019	10.130.614,70			10.130.614,70
07/2019	4.683.054,25	14.095,87		4.668.958,38
08/2019	4.661.168,61			4.661.168,61
09/2019	6.692.727,22			6.692.727,22
10/2019	3.644.592,21	17.678,19		3.626.914,02
11/2019	1.219.736,18	15.030,00		1.204.706,18
12/2019	1.375.656,88			1.375.656,88
01/2020	2.720.435,75			2.720.435,75
		Saldo Financeiro em 31/01/2020		145.692.642,04
Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos				
Taxa de Juros Anual:	5,8800 %	Índice de Inflação:		IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano		No Mês
IPCA	4,1917 %	0,2100 %		0,2100 %
Juros	5,8800 %	0,4773 %		0,4773 %
Meta	10,3181 %	0,6883 %		0,6883 %
Rentabilidade %	9,4778 %	0,3617 %		0,3617 %
Rentabilidade R\$	10.728.593,47	515.268,24		515.268,24
Resultado %	-0,7617 %	-0,3243 %		-0,3243 %
Resultado R\$	-948.360,64	-465.223,72		-465.223,72

Quadro 20

Nota: Os valores de **Receitas** representam os valores de Contribuições Previdenciárias (ativos, aposentados e pensionistas), já as **Despesas** referem-se aos valores de Folha de Pagamento (aposentados e pensionistas).

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2019	31/01/2020	nov/19	dez/19	jan/20	TRIMESTRE	2020	ULTIMOS 12 MESES
BRASESCO INST. FIC F1 RF IMA B5	R\$ 9.189.306,67	R\$ 9.240.593,21	(0,3896)	1,2300	0,5581	1,3984%	0,5581%	NC
BRASESCO INST. ALOC. DINAMICA	R\$ 3.267.102,47	R\$ 3.281.112,33	(0,3291)	0,8500	0,4288	0,9492%	0,4288%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE								
TOTAL	R\$ 12.456.409,14	R\$ 12.521.705,54						

Quadro 21

Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Município de Governo Amazonas / AM - DEFENSORIA2020

12/02/2020 16:25:08

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 31/01/2020		
		Saldo Financeiro em 31/01/2019		2.454.326,96
Mês/Ano	Receitas RS	Despesas RS	Resultado RS	
02/2019	610.322,80	0,00	610.322,80	
03/2019	627.819,72	0,00	627.819,72	
04/2019	637.839,76	0,00	637.839,76	
05/2019	648.474,00	0,00	648.474,00	
06/2019	664.320,93	0,00	664.320,93	
07/2019	683.371,79	0,00	683.371,79	
08/2019	775.936,11	0,00	775.936,11	
09/2019	779.947,37	0,00	779.947,37	
10/2019	784.381,09	0,00	784.381,09	
11/2019	780.946,33	0,00	780.946,33	
12/2019	2.476.831,17	0,00	2.476.831,17	
01/2020	0,00	0,00	0,00	
		Saldo Financeiro em 31/01/2020		12.521.705,54
Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos				
Taxa de Juros Anual:	5,8800 %	Índice de Inflação:	IPCA	
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês	
IPCA	4,1917 %	0,2100 %	0,2100 %	
Juros	5,8800 %	0,4773 %	0,4773 %	
Meta	10,3181 %	0,6883 %	0,6883 %	
Rentabilidade %	9,5972 %	0,5242 %	0,5242 %	
Rentabilidade RS	597.187,51	65.296,40	65.296,40	
Resultado %	-0,6535 %	-0,1630 %	-0,1630 %	
Resultado RS	-44.344,93	-20.437,64	-20.437,64	

Quadro 22

Nota: Os valores de **Receitas** representam os valores de Contribuições Previdenciárias (ativos, aposentados e pensionistas), já as **Despesas** referem-se aos valores de Folha de Pagamento (aposentados e pensionistas).

6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)							
	31/12/2019	31/01/2020	out19	nov19	dez19	jan20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRASESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 22.151.234,44	R\$ 21.989.827,29	1,6870	(0,3896)	1,2300	0,5581	1,3984%	0,5581%	NC	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 2.512.980,82								
TOTAL	R\$ 22.151.234,44	R\$ 24.502.808,11								

Quadro 23

Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

6.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Município de Governo Amazonas / AM - TRIBUNAL JUSTICA 2020

12/02/2020 17:08:53

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 31/01/2020		
		Saldo Financeiro em 31/01/2019		0,00
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$	
02/2019	0,00	0,00	0,00	
03/2019	1.124.231,98	0,00	1.124.231,98	
04/2019	1.129.159,87	0,00	1.129.159,87	
05/2019	1.132.493,24	0,00	1.132.493,24	
06/2019	1.138.021,63	241.430,62	896.591,01	
07/2019	2.565.437,98	291.519,39	2.273.918,59	
08/2019	3.884.077,90	67.916,92	3.816.160,98	
09/2019	2.508.252,24	494.376,53	2.013.875,71	
10/2019	2.781.927,34	277.820,43	2.504.106,91	
11/2019	2.561.139,60	248.791,25	2.312.348,35	
12/2019	5.065.716,87	398.911,86	4.666.805,01	
01/2020	2.510.168,73	282.179,91	2.227.988,82	
		Saldo Financeiro em 31/01/2020		24.502.808,11
Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos				
Taxa de Juros Anual:	5,8800 %	Índice de Inflação:	IPCA	
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês	
IPCA	4,1917 %	0,2100 %	0,2100 %	
Juros	5,8800 %	0,4773 %	0,4773 %	
Meta	10,3181 %	0,6883 %	0,6883 %	
Rentabilidade %	5,2203 %	0,5579 %	0,5579 %	
Rentabilidade R\$	405.127,64	123.584,85	123.584,85	
Resultado %	-4,6210 %	-0,1295 %	-0,1295 %	
Resultado R\$	-386.079,03	-28.876,01	-28.876,01	

Quadro 24

Nota: Os valores de **Receitas** representam os valores de Contribuições Previdenciárias (ativos, aposentados e pensionistas), já as **Despesas** referem-se aos valores de Folha de Pagamento (aposentados e pensionistas).

7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/12/2019	31/01/2020	out/19	nov/19	dez/19	jan/20	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO INST. FIC. FI. RF. IMA B 5	R\$ 3.506.553,79	R\$ 3.777.030,73	1,6870	(0,3896)	1,2300	0,5581	1,3984%	0,5581%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 446.409,65							
TOTAL	R\$ 3.506.553,79	R\$ 4.223.440,38							

Quadro 25

Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

7.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Município de Governo Amazonas / AM - TRIBUNALCONTAS2020

12/02/2020 17:06:40

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 31/01/2020	
Mês/Ano	Receitas RS	Despesas RS	Resultado RS
		Saldo Financeiro em 31/01/2019	0,00
02/2019	0,00	0,00	0,00
03/2019	0,00	0,00	0,00
04/2019	0,00	0,00	0,00
05/2019	0,00	0,00	0,00
06/2019	446.815,11	0,00	446.815,11
07/2019	449.663,70	0,00	449.663,70
08/2019	456.011,93	0,00	456.011,93
09/2019	526.068,24	0,00	526.068,24
10/2019	447.922,04	0,00	447.922,04
11/2019	889.854,89	0,00	889.854,89
12/2019	205.915,34	0,00	205.915,34
01/2020	696.572,08	0,00	696.572,08
		Saldo Financeiro em 31/01/2020	4.223.440,38
Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos			
Taxa de Juros Anual:	5,8800 %	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	4,1917 %	0,2100 %	0,2100 %
Juros	5,8800 %	0,4773 %	0,4773 %
Meta	10,3181 %	0,6883 %	0,6883 %
Rentabilidade %	9,5295 %	0,5793 %	0,5793 %
Rentabilidade RS	104.617,05	20.314,51	20.314,51
Resultado %	-0,7149 %	-0,1082 %	-0,1082 %
Resultado RS	-8.411,39	-3.820,14	-3.820,14

Quadro 26

Nota: Os valores de **Receitas** representam os valores de Contribuições Previdenciárias (ativos, aposentados e pensionistas), já as **Despesas** referem-se aos valores de Folha de Pagamento (aposentados e pensionistas).

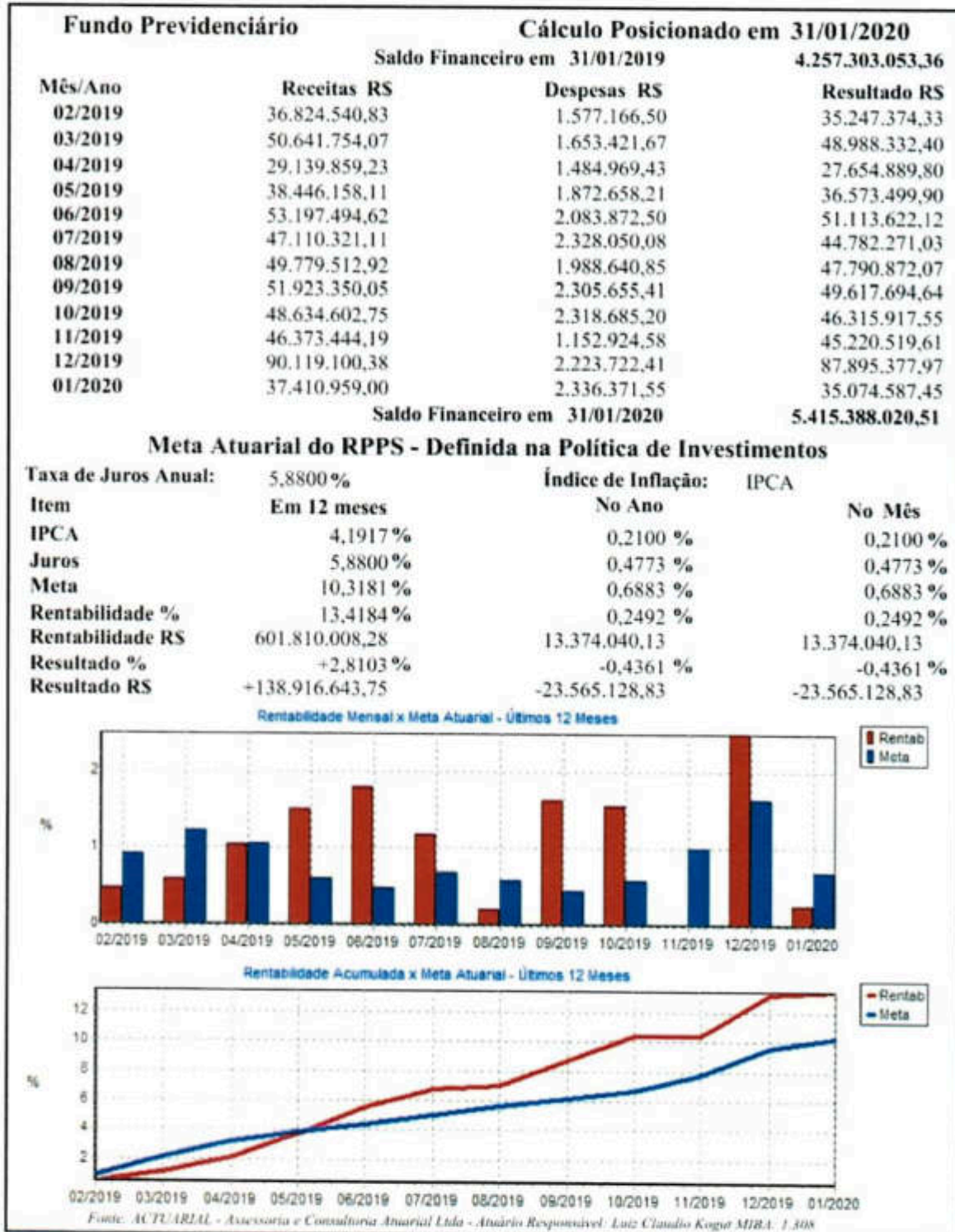
8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Município de Governo Amazonas / AM - CONSOLIDADO2020

12/02/2020 17:10:54



Quadro 27

Nota: Os valores de **Receitas** representam os valores de Contribuições Previdenciárias (ativos, aposentados e pensionistas), já as **Despesas** referem-se aos valores de Folha de Pagamento (aposentados e pensionistas).

Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

9. RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/12/2019	31/01/2020
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	6.169.425,02	1.998.151,55
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	29.697.707,36	-
BRADESCO FIC FI RF ALOC. DINÂMICA - COMPREV	R\$ 3.941.552,96	R\$ 4.207.956,23
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ -	R\$ 7.409.440,98
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 34.976,25	R\$ 79.595.506,82
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 191.308,78	R\$ 69.812,13
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 40.034.970,37	R\$ 93.280.867,71

Quadro 28

Nota 1: Os valores recebidos de Contribuição Previdenciária no FFIN são utilizados no pagamento das folhas de aposentados e pensionistas dessa massa previdenciária.

Nota 2: O saldo de Cobertura do Déficit refere-se aos valores pendentes de Consignação sobre as folhas de aposentados e pensionistas, já regularizados em janeiro/2020.

Nota 3: Em decorrência da mudança no calendário de pagamentos de inativos e pensionistas para o início do mês subsequente, os valores recebidos são mantidos em fundo de curto prazo e indexados ao CDI.

9.2 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/12/2019	31/01/2020
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 456.851,77	R\$ 458.457,08
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 456.851,77	R\$ 458.457,08

Quadro 29

9.3 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/12/2019	31/01/2020
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 208.719,44	R\$ 310.902,41
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ -	R\$ 511.918,74
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ -
TOTAL	R\$ 208.720,44	R\$ 822.821,15

Quadro 30

9.4 Composição do Recursos – ALE FFIN

DESCRIÇÃO	nov/19	dez/19	jan/20
SALDO ANTERIOR	R\$ 207.344,82	R\$ 377.518,95	R\$ 208.720,44
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	R\$ 909.931,15	R\$ 1.157.020,68	R\$ 1.663.105,76
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ 988.062,80	R\$ 2.720.427,93	R\$ 706.868,30
VARIAÇÃO FINANCEIRA	R\$ 1.195,61	R\$ 1.546,01	R\$ 10.791,43
(-) SAIDAS FINANCEIRAS	-R\$ 1.729.015,43	-R\$ 4.047.793,13	-R\$ 1.766.664,78
SALDO FINAL	R\$377.518,95	R\$ 208.720,44	R\$ 822.821,15

Quadro 31

Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/12/2019	31/01/2020
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 388.158,17	R\$ 381.385,15
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 388.159,17	R\$ 381.386,15

Quadro 32

10. TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2019	31/01/2020	nov/19	dez/19	jan/20	TRIMESTRE	2020	ULTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 364.957,98	R\$ 5.393.335,41	0,3562	0,3500	0,3514	1,0614%	0,3514%	5,5098%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 40.759.574,94	R\$ 37.083.234,12	(0,5077)	0,5934	0,8193	0,9027%	0,8193%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00						
TOTAL	R\$ 41.124.533,92	R\$ 42.476.570,53						

Quadro 33

Nota: Utilizados os recursos do fundo Caixa FIC Brasil Gestão estratégica para pagamentos de despesas com custeio administrativo, registrado através do Ofício nº. 5.639/2019.

10.2 Taxa de Administração - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2019	31/01/2020	nov/19	dez/19	jan/20	TRIMESTRE	2020	ULTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 799.940,92	R\$ 876.485,48	0,3562	0,3500	0,3514	1,0613%	0,3514%	5,5097%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 0,00	R\$ -						
TOTAL	R\$ 799.940,92	R\$ 876.485,48						

Quadro 34

10.3 Taxa de Administração - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2019	31/01/2020	nov/19	dez/19	jan/20	TRIMESTRE	2020	ULTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 328.741,68	R\$ 329.896,83	0,3562	0,3500	0,3514	1,0613%	0,3514%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	-	-						
TOTAL	R\$ 328.741,68	R\$ 329.896,83						

Quadro 35

10.3 Taxa de Administração – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2019	31/01/2020	nov/19	dez/19	jan/20	TRIMESTRE	2020	ULTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.087.176,96	R\$ 1.090.997,15			0,3514	0,3514%	0,3514%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	-	-						
TOTAL	R\$ 1.087.176,96	R\$ 1.090.997,15						

Quadro 36

Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

11. OUTROS RECURSOS

11.1 Tribunal de Justiça do Estado - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/12/2019	31/01/2020	nov/19	dez/19	jan/20	TRIMESTRE	2019	ULTIMOS 12 MESES
BRADESCO MANI PODER PÚBLICO	R\$ 19.013.987,59	R\$ 13.622.192,29	-	-	0,3514	0,3514%	0,3514%	0,3514%
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TJA	R\$ 186.059.516,72	R\$ 186.845.753,37	0,3144	0,4024	0,4226	1,1437%	0,4226%	6,3981%
BB PREV. RF IRF MI - TJA	R\$ 181.965.690,21	R\$ 182.748.838,08	0,3068	0,3973	0,4194	1,1277%	0,4194%	6,3271%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ -						
TOTAL	R\$ 387.059.195,52	R\$ 383.216.783,74						

Quadro 37

11.2 Composição dos Saldos - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	nov/19	dez/19	jan/20
SALDO ANTERIOR	393.179.474,17	390.517.920,47	387.059.195,52
CONTRIB. PREVIDENCIÁRIA	5.671.046,97	11.059.829,84	5.482.791,26
VARIAÇÃO FINANCEIRA	1.194.740,16	1.541.918,38	1.603.814,02
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(9.527.340,83)	(16.060.473,17)	(10.929.017,06)
SALDO FINAL	R\$ 390.517.920,47	R\$ 387.059.195,52	R\$ 383.216.783,74

Quadro 38

Nota: Os Repasses e as Saídas Financeiras são representados pelos créditos recebidos e pagamento dos pensionistas desses órgãos, ambos registrados sob regime de Caixa. Para pagamento das folhas de aposentados e pensionistas está sendo utilizado o recurso já repassado anteriormente, não havendo repasse de cobertura de débito nesse momento.

11.3 Tribunal de Contas do Estado - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/12/2019	31/01/2020	nov/19	dez/19	jan/20	TRIMESTRE	2019	ULTIMOS 12 MESES
BRADESCO MANI PODER PÚBLICO	R\$ 672.131,48	R\$ 3.275.123,84	-	-	0,3514	0,3514%	0,3514%	0,3514%
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TCE	R\$ 73.160.490,47	R\$ 73.469.646,69	0,3144	0,4024	0,4226	1,1437%	0,4226%	6,3981%
BB PREV. RF IRF MI - TCE	R\$ 71.423.609,39	R\$ 66.718.348,59	0,3068	0,3973	0,4194	1,1277%	0,4194%	6,3271%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 7.771,82	R\$ 4.292,84						
TOTAL	R\$ 145.264.003,16	R\$ 143.467.411,76						

Quadro 39

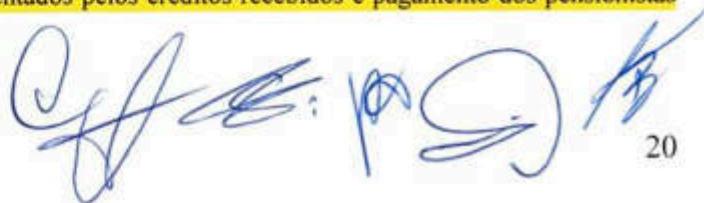
Nota: Os Repasses e as Saídas Financeiras são representados pelos créditos recebidos e pagamento dos pensionistas desses órgãos, ambos registrados sob regime de Caixa. Para pagamento das folhas de aposentados e pensionistas está sendo utilizado o recurso já repassado anteriormente, não havendo repasse de cobertura de débito nesse momento.

11.4 Composição dos Saldos - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	out/19	nov/19	dez/19
SALDO ANTERIOR	155.668.630,53	153.839.732,97	152.538.769,82
CONTRIB. PREVIDENCIÁRIA	1.738.581,72	2.670.383,28	1.281.462,77
VARIAÇÃO FINANCEIRA	915.133,66	464.465,88	1.518.013,09
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(4.482.612,94)	(4.435.812,31)	(10.082.013,34)
SALDO FINAL	R\$ 153.839.732,97	R\$ 152.538.769,82	R\$ 145.256.232,34

Quadro 40

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



Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

12. ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS

12.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
TITULOS DO TN	R\$ 644.178.288,75	10,86%	10%	100%	art. 7º, inciso I, "a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 249.467.186,47	26,56%	10%	100%	art. 7º, inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 19.869.083,18				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 13.030.298,77				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 81.912.874,73				
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 260.315.400,06				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 621.561.444,03				
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 44.868.865,68				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 53.144.822,25				
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 54.414.287,42				
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 111.209.977,41				
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 65.403.254,72				
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 29.914.484,75	36,77%	30%	40%	art. 7º, inciso IV, "a"
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 198.751.146,37				
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 110.036.876,65				
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 119.518.129,10				
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 951.811.398,87				
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 239.460.749,81				
SANTANDER RF ATIVO FIC FI	R\$ 92.510.317,31				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 438.610.373,12				
ICATU VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 13.362.845,11				
TITULOS CVS	R\$ 12.044.727,52				
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 4.425.396.832,08	74,62%			TITULO NÃO REGISTRADO NO SIC

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020		Resolução CMN nº 3.922/2010				
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR					
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 33.087.522,09	1,00%	10%	30%	art. 8º, inciso I, "a"				
ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FI	R\$ 26.280.760,34								
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 10.512.308,42	24,06%	20%	20%	art. 8º, inciso II, "a"				
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 83.954.695,82								
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 97.686.134,27								
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 99.245.902,86								
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 164.487.751,26								
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 180.758.123,74								
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 57.227.707,88								
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 272.795.418,19								
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 222.360.991,89								
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 109.399.964,55								
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$ 51.644.933,73								
SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 76.728.076,02								
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 19.313.414,95					0,33%	1%	3%	art. 8º, inciso III
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ -								
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.505.483.706,01	25,38%							
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 5.930.880.538,09	100,00%							

Quadro 41

Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% CARTEIRA	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM I FIC FI	RS 249.467.186,47	4,10%	20%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	RS 19.869.083,18	0,33%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	RS 13.030.298,77	0,21%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	RS 81.912.874,73	1,35%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	RS 951.811.398,87	15,65%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	RS 97.686.134,27	1,61%	
CAIXA FI BRASIL IRF M I TP RF	RS 260.315.400,06	4,28%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	RS 621.561.444,03	10,22%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	RS 44.868.865,68	0,74%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	RS 53.144.822,25	0,87%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	RS 29.914.484,75	0,49%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	RS 198.751.146,37	3,27%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	RS 110.036.876,65	1,81%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	RS 119.518.129,10	1,97%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	RS 33.087.522,09	0,54%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	RS 83.954.695,82	1,38%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	RS 239.460.749,81	3,94%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	RS 438.610.373,12	7,21%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	RS 10.512.308,42	0,17%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	RS 180.758.123,74	2,97%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	RS 57.227.707,88	0,94%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	RS 99.245.902,86	1,63%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	RS 164.487.751,26	2,70%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	RS 272.795.418,19	4,49%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	RS 13.362.845,11	0,22%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	RS 54.414.287,42	0,89%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	RS 111.209.977,41	1,83%	
ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI	RS 26.280.760,34	0,43%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	RS 222.360.991,89	3,66%	
SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES	RS 76.728.076,02	1,26%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	RS 109.399.964,55	1,80%	
SANTANDER SELEÇÃO 30	RS 51.644.933,73	0,85%	
SANTANDER RF ATIVO FIC FI	RS 92.510.317,31	1,52%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	RS 19.313.414,95	0,32%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	RS 65.403.254,72	1,08%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO	RS 5.274.657.521,82		

Quadro 42

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

Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

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

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - RS	% DO PL DO FUNDO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	RS 249.467.186,47	7.374.284.212,96	3,38%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	RS 19.869.083,18	692.095.869,22	2,87%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	RS 13.030.298,77	2.287.850.661,28	0,57%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	RS 81.912.874,73	6.900.045.813,02	1,19%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	RS 951.811.398,87	10.446.730.359,40	9,11%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	RS 97.686.134,27	828.085.660,89	11,80%	
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO	RS 29.914.484,75	322.808.109,21	9,27%	
BRADERCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	RS 198.751.146,37	4.996.174.196,71	3,98%	
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	RS 110.036.876,65	841.556.111,01	13,08%	
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	RS 119.518.129,10	1.129.534.794,06	10,58%	
BRADERCO INST IBR X ALPHA	RS 33.087.522,09	243.235.839,22	13,60%	
BRADERCO FIA MID SMALL CAPS	RS 83.954.695,82	2.245.635.949,92	3,74%	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	RS 260.315.400,06	10.529.932.746,92	2,47%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	RS 621.561.444,03	9.706.276.068,00	6,40%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	RS 44.868.865,68	262.706.959,14	17,08%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	RS 53.144.822,25	216.883.023,79	24,50%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	RS 438.610.373,12	10.137.125.534,47	4,33%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	RS 99.245.902,86	976.920.578,79	10,16%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	RS 239.460.749,81	5.214.674.759,25	4,59%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	RS 10.512.308,42	889.485.663,39	1,18%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	RS 164.487.751,26	2.499.126.681,70	6,58%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	RS 180.758.123,74	4.585.787.416,19	3,94%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	RS 57.227.707,88	1.984.426.221,74	2,88%	
SANTANDER SELEÇÃO 30	RS 51.644.933,73	1.949.358.088,05	2,65%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	RS 76.728.076,02	767.681.560,64	9,99%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	RS 109.399.964,55	976.350.553,84	11,20%	
SANTANDER RF ATIVO FIC FI	RS 92.510.317,31	853.720.753,34	10,84%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	RS 272.795.418,19	2.139.496.712,77	12,75%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	RS 54.414.287,42	509.345.173,17	10,68%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	RS 111.209.977,41	1.233.983.108,17	9,01%	
ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI	RS 26.280.760,34	208.826.727,06	12,58%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	RS 65.403.254,72	1.727.280.862,91	3,79%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	RS 222.360.991,89	1.987.548.215,87	11,19%	
TOTAL	RS 5.241.981.261,76			

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14, § 1º	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - RS	% DO PL	Resolução CMN nº 3.922/2010
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	RS 19.313.414,95	412.733.691,20	4,68%	5%
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	RS 13.362.845,11	533.023.517,39	2,51%	
TOTAL	RS 32.676.260,06			

TOTAL	RS 5.274.657.521,82
--------------	----------------------------

Quadro 43

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

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

Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

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

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 os fundos Caixa FI Brasil 2020 V TP RF e Caixa FI Brasil 2024 VI TP RF encontram-se enquadrados, pois o resgate dessas aplicações ocorrerá no vencimento dos TPF que compõe a carteira dos fundos, ou seja, 16/08/2020 e 16/08/2024, respectivamente.

Nota 5: Registra-se o Desenquadramento ao Art. 14º da Resolução CMN nº. 3.922/10 referente a aplicação Bradesco Inst IBR X Alpha. De acordo com a instituição tratou-se de Desenquadramento passivo devido à resgates da aplicação ao final do mês de dezembro/2019, contudo, tal situação não deve gerar qualquer prejuízo à Amazonprev, pois nesse caso, prevalece o que está estabelecido no art. 21, Nota 3 acima.

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA DEZ/19) EM R\$ MI	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (JANEIRO/2020)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB DTVM S.A	R\$ 1.046.304,99	R\$ 1.413.776.976,29	0,1351%	5%
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 770.368,03	R\$ 652.446.641,11	0,0847%	
BRADESCO	R\$ 560.425,00	R\$ 575.262.854,78	0,1026%	
CAIXA	R\$ 374.738,64	R\$ 1.517.746.808,00	0,4050%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	R\$ 291.395,29	R\$ 330.283.291,61	0,1133%	
BANCO BTG	R\$ 109.006,18	R\$ 222.360.991,89	0,2040%	
BANCO SAFRA	R\$ 100.718,41	R\$ 84.716.669,67	0,0841%	
ICATÚ VANGUARDA DTVM S/A	R\$ 23.654,59	R\$ 478.063.288,47	2,0210%	

Quadro 44

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

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

DISTRIBUIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR GESTOR DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS

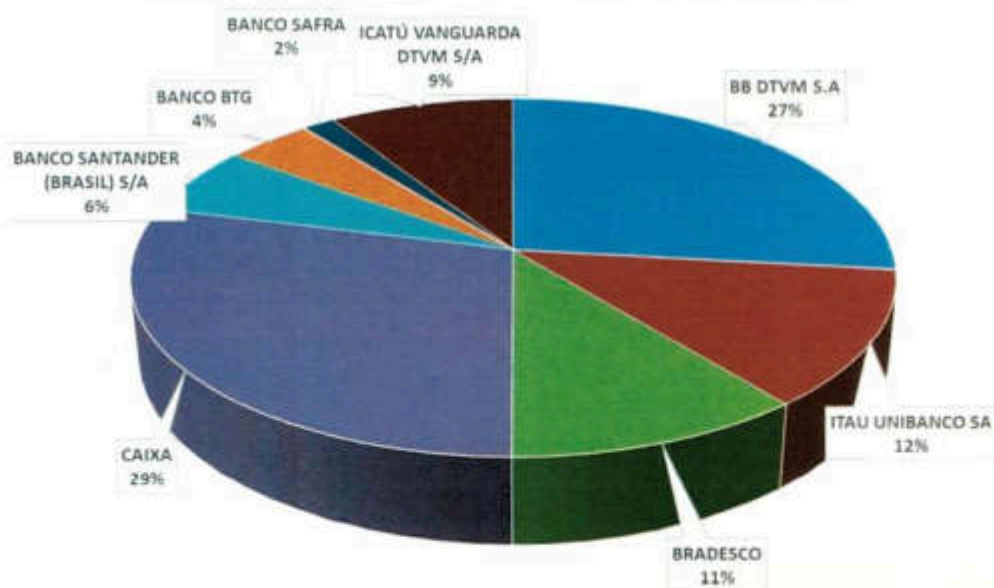


Gráfico 4.

Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

13. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS - AMAZONPREV

FPREV PODER EXECUTIVO	SALDO
FUNDO DE INVESTIMENTO FPREV - EXECUTIVO	R\$ 4.501.353.624,21
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 641.996.806,11
TÍTULOS PÚBLICOS - CVS	R\$ 12.044.727,52
IMÓVEIS	R\$ 60.353.005,55
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EXECUTIVO	R\$ 5.790,46
TOTAL	R\$ 5.215.753.953,85

ASSEMBLEIA LEGISLATIVA	SALDO
ALE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 10.511.987,97
ALE FPREV TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.181.482,63
ALE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
ALE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 310.902,41
ALE FFIN DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - ALE COBERTURA	R\$ 511.918,74
TOTAL	R\$ 13.516.291,75

PROCURADORIA GERAL DE JUSTIÇA - PGJ/MPE	SALDO
MPE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 145.692.642,04
MPE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
MPE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 381.385,15
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - PGJ/MPE - FFIN	R\$ 1,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - MPE COBERTURA	R\$ -
TOTAL	R\$ 146.074.028,19

DEFENSORIA PÚBLICA - DPE/AM	SALDO
DPE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 12.521.705,54
DPE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
DPE - FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 458.457,08
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - DPE - FFIN	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - DPE COBERTURA	R\$ -
TOTAL	R\$ 12.980.162,62

TRIBUNAL DE JUSTIÇA - TJ/AM	SALDO
TJ/AM FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 383.216.783,74
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA	R\$ -
TJ/AM - FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 21.989.827,29
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA - FPREV	R\$ 2.512.980,82
TOTAL	R\$ 407.719.591,85

TRIBUNAL DE CONTAS DO ESTADO - TCE/AM	SALDO
TCE/AM FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 143.463.118,92
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TCE	R\$ 4.292,84
TCE/AM - FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 3.777.030,73
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TCE/FPREV	R\$ 446.409,65
TOTAL	R\$ 147.690.852,14

OUTROS RECURSOS	SALDO
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO EXECUTIVO	R\$ 42.476.569,53
DISP. FINANCEIRA - TAXA DE ADM EXECUTIVO	R\$ 1,00
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - ALE	R\$ 876.485,48
DISP. FINANCEIRA - TX DE ADM ALE	R\$ -
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO TCE	R\$ 329.896,83
DISP. FINANCEIRA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO TCE	R\$ -
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO TJA	R\$ 1.090.997,15
DISP. FINANCEIRA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO TJA	R\$ -
FUNDO FINANCEIRO - EXECUTIVO	R\$ 1.998.151,55
FUNDO FINANCEIRO - COMPREV	R\$ 4.207.956,23
DISP. FINANCEIRA - FFIN EXECUTIVO	R\$ -
DISP. FINANCEIRA - FFIN EXECUTIVO - COBERT DEFICIT	R\$ 79.595.506,82
DISP. FINANCEIRA - SAL. NÃO RECLAMADOS	R\$ 69.812,13
DISP. REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 7.409.440,98
TOTAL	R\$ 138.054.817,70
TOTAL GERAL	R\$ 6.081.789.698,10

Quadro 45



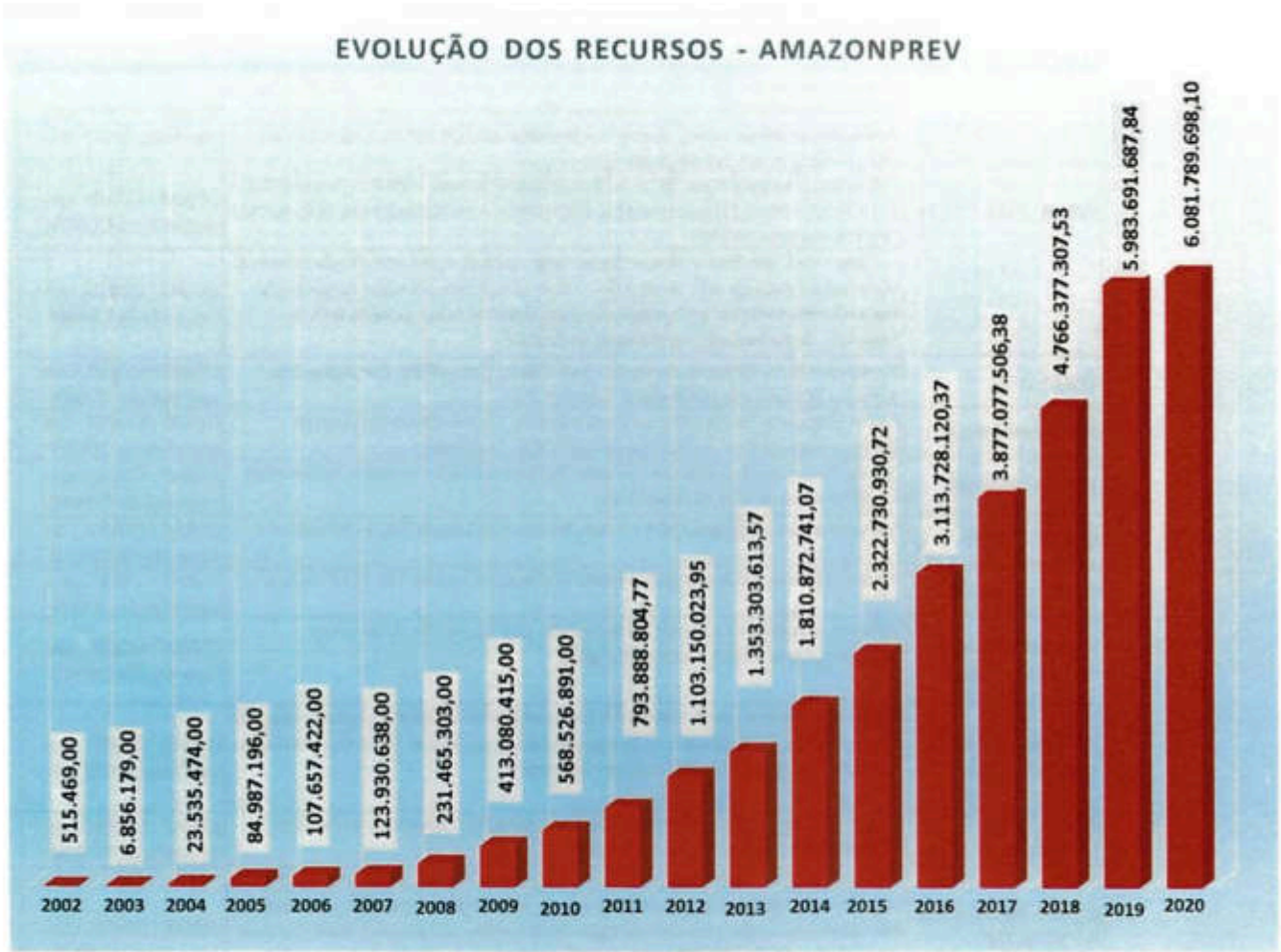


Gráfico 5.

Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

15. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV EXECUTIVO:	a) Novos Recursos: direcionar para o fundo ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP (19.719.727/0001-51) o montante de R\$ 11.000.000,00 (onze milhões de reais), direcionado os demais valores recebidos para o fundo CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA. (23.215.097/0001-55)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	16/03/2020
	b) Recursos Atuais: Migrar R\$ 20 milhões aplicados nos fundos BB Previdenciário IDKA 2 (13.322.205/0001-35) para o SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NIVEL 1 PB (19.436.818/0001-80)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	PRAZO
	c) Fundos de Curto Prazo: Manter, regularmente, saldo de aplicação no fundo Bradesco Maxi Poder Público no valor de R\$ 2.000.000,00 (dois milhões de reais), já que possui baixa automática otimizando o processo de pagamentos de rotina, incluindo folha de pagamento de aposentados e pensionistas do FPREV.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	16/03/2020
FPREV ALE:	Recursos Atuais: direcionar os recursos para o fundo Caixa Gestão Estratégica, Itaú Alocação Dinâmica e Icatu Vanguarda Inflação CP LP.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	16/03/2020
FPREV MPE/PGJ:	Novos Recursos: Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Alocação Dinâmica, visando obter resultados acima do CDI no Longo prazo	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	16/03/2020
FPREV - DPE/AM	Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Alocação Dinâmica, visando obter resultados acima do CDI no Longo prazo	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	16/03/2020
FPREV - TJ/AM	Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Institucional FIC FI RF IMA-B 5	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	16/03/2020
FPREV - TCE/AM	Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Institucional FIC FI RF IMA-B 5	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	16/03/2020
Outros Repasses – TCE e TJAM	a) Novos recursos: os novos recursos recebidos pelo TCE e TJAM, devem ser direcionados para o fundo Maxi Poder Público	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	16/03/2020
FFIN - EXECUTIVO, ALE, DPE e MPE	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	16/03/2020
RECURSOS COMPREV	Manter os recursos aplicados no fundo Bradesco Alocação Dinâmica, de forma manter o enquadramento dos recursos da Amazonprev	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	16/03/2020
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	16/03/2020
Atividades Externas	Participação dos membros do Comitê no evento: 2º Congresso de Investimentos - ABIPEM	COMIV	11 a 13 de março/2020

Quadro 46.

Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

16. RELATÓRIO DE RISCO DOS ATIVOS

16.1 ACOMPANHAMENTO DOS RISCOS POR FUNDO DE INVESTIMENTOS

FUNDOS DE INVESTIMENTOS	VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE	DRAWDOWN	
	MÊS %	12 M %	MÊS %	12 M %	12 M %	MÊS %	12 M %
BB PREV RF IDKA 2	1,12%	1,49%	1,87%	2,50%	3,00137	-0,14%	-0,49%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	5,32%	7,30%	8,76%	12,09%	2,11641	-3,20%	-4,84%
BB PREVID RF IRFM 1 TP	0,19%	0,26%	0,33%	0,45%	2,33064	-0,01%	-0,03%
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC DE FI	1,49%	2,34%	2,47%	3,89%	2,31750	-0,36%	-1,22%
BB PREVID TIT PUB VII FI	0,79%	1,23%	1,31%	2,05%	2,79092	-0,10%	-0,52%
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	19,61%	17,35%	32,20%	28,66%	1,71854	-5,62%	-8,96%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	1,35%	2,18%	2,23%	3,62%	2,20314	-0,47%	-1,20%
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	18,56%	15,70%	30,62%	25,98%	-0,34264	-4,73%	-7,05%
BRADESCO FI REFER DI PREMIUM	0,02%	0,05%	0,04%	0,00%	-1,29403	0,00%	0,00%
BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL	20,05%	17,43%	32,98%	28,75%	0,94143	-4,65%	-8,04%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	1,36%	2,05%	2,27%	3,42%	2,89254	-0,11%	-0,81%
BRADESCO MAXI PD PÚBLICO	0,00%	0,04%	0,02%	0,09%	-5,01907	0,00%	0,00%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	17,38%	16,84%	28,68%	27,81%	1,53759	-3,45%	-7,45%
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	0,65%	3,86%	1,06%	6,36%	-1,01496	-0,12%	-2,72%
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	2,09%	5,00%	3,47%	8,25%	0,81842	-0,22%	-3,54%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF	1,32%	1,97%	2,19%	3,28%	3,00723	-0,11%	-0,71%
CAIXA FI BRASIL IRFM 1	0,18%	0,25%	0,32%	0,43%	2,68839	-0,01%	-0,03%
CAIXA FIA CONSUMO	20,60%	17,85%	34,04%	29,51%	2,04601	-4,51%	-10,18%
CAIXA GESTÃO ESTRATEGICA	1,31%	3,64%	2,19%	6,04%	2,15520	-0,19%	-2,73%
FIC CAIXA CAPITAL PROTEGIDO	10,86%	3,68%	17,64%	6,07%	-0,30082	-4,81%	-4,81%
ICATU DIVIDENDOS FIA	14,88%	14,67%	24,50%	24,23%	1,46179	-3,29%	-6,99%
ICATU INFLAÇÃO CRÉDITO PRIVADO	1,41%	1,95%	2,37%	3,24%	2,88438	-0,08%	-1,13%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA	1,36%	2,01%	2,27%	3,35%	2,98799	-0,11%	-0,74%
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA	5,41%	7,30%	8,90%	12,08%	2,09640	-3,39%	-4,89%
ICATU VANGUARD AÇÕES IBRX FI	20,28%	17,76%	33,29%	29,29%	0,76394	-4,88%	-9,44%
ITAU AÇÕES PHOENIX FIC FI	19,97%	17,81%	32,93%	29,42%	1,41403	-4,69%	-9,05%
ITAU DUNAMIS FIC	17,90%	16,67%	29,44%	27,54%	1,53056	-3,75%	-9,59%
ITAU FOF RPI AÇÕES	18,78%	16,58%	30,93%	27,37%	1,07473	-4,10%	-9,09%
ITAU SMALL CAPS VALUATION	19,13%	17,02%	31,50%	28,15%	2,18756	-6,80%	-8,99%
ITAU INSTIT ALOC DINÂMICA RF FIC	0,00%	1,86%	0,02%	3,09%	1,98826	0,00%	-1,15%
SAFRA IMA INST. FI FIC RF	3,90%	5,47%	6,43%	9,07%	2,29138	-1,49%	-3,33%
SAFRA S&P REAIS PB MM	12,28%	12,36%	20,22%	20,41%	1,42446	-2,86%	-6,70%
SANTANDER AÇÕES TOP SELEÇÃO	20,20%	17,31%	33,21%	28,56%	0,88513	-4,90%	-7,65%
SANTANDER ATIVO RENDA FIXA	0,06%	2,39%	0,12%	3,99%	2,95405	0,00%	-1,64%
SANTANDER FIC FI IMA B	3,42%	4,88%	5,63%	8,09%	2,35713	-1,60%	-2,97%
SANTANDER ATIVO FIC RF	0,06%	2,39%	0,12%	3,99%	2,95405	0,00%	-1,64%
SANTANDER FIC IMA-B 5 TIT PUB RF	1,32%	1,96%	2,19%	3,27%	3,04147	-0,11%	-0,71%
SANTANDER SELEÇÃO 30	20,32%	17,25%	33,41%	28,46%	0,87130	-4,93%	-7,84%
SANTANDER IBOVESPA AÇÕES	21,12%	17,54%	34,70%	28,92%	0,76355	-5,20%	-8,80%

RISCOS DA CARTEIRA AMAZONPREV

CARTEIRA AMAZONPREV	4,70%	2,87%	7,74%	4,77%	2,53638	-1,09%	-1,12%
---------------------	-------	-------	-------	-------	---------	--------	--------

Quadro 47.

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.

Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

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.



16.2 DETALHAMENTO POR FUNDO DE INVESTIMENTOS

FUNDOS DE INVESTIMENTOS	CNPJ	ARBITR	ESQ. UBIAMENSO	IMPONIBIL	SALDO	PLAZO DE MATURACAO ATIVO	PLAZO DE RENDITE	LAGRIMS	STRATEGIA DE ABRILHA PELA ADMINISTRADORA	COMPORTA VOLATILIDADE REFERENCIAL (RISCO)	TAXA DE IMPORTECADO
BB PREM FID IMA 2	13.322.205/0001-35	BB DTVM	ART. 7.º, I, "b"	IMA-PCA 2A	41.932.474,73	INDETERMINADO	D=1	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	1,000%
BB PREM FID IMA 1 TP	13.338.880/0001-35	BB DTVM	ART. 7.º, I, "b"	IMA-MI	294.827.386,47	INDETERMINADO	D=1	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	2,000%
BRADSECO FID REFER DI PREM IUM	01.799.413/0001-90	BRAM - DTVM	ART. 7.º, IV, "a"	CDI	198.751.146,37	INDETERMINADO	D=0	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,200%
BRADSECO FID REFER DI PREM PUB	08.246.353/0001-97	BRAM - DTVM	ART. 7.º, IV, "a"	CDI	29.914.484,75	INDETERMINADO	D=0	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,200%
NTM-B	-	TESOURO NACIONAL	ART. 7.º, I, "a"	IPCA + 6,48% a.a	151.623.040,85	15/06/2023	D=1	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
NTM-B	-	TESOURO NACIONAL	ART. 7.º, I, "a"	IPCA + 6,50% a.a	161.912.644,06	15/06/2030	D=1	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
NTM-B	-	TESOURO NACIONAL	ART. 7.º, I, "a"	IPCA + 6,50% a.a	161.125.069,49	15/06/2030	D=1	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
NTM-B	-	TESOURO NACIONAL	ART. 7.º, I, "a"	IPCA + 6,60% a.a	165.498.874,34	15/06/2040	D=1	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
ONS - A	-	TESOURO NACIONAL	Em esquadramento	0,90% a.m	1.449.479,30	01/01/2027	-	LONGO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
ONS - B	-	TESOURO NACIONAL	Em esquadramento	3,12% a.a	9.178.758,30	01/01/2027	-	LONGO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
ONS - C	-	TESOURO NACIONAL	Em esquadramento	0,90% a.m	188.018,20	01/01/2027	-	LONGO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
ONS - D	-	TESOURO NACIONAL	Em esquadramento	3,12% a.a	1.028.505,72	01/01/2027	-	LONGO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
BB PREM FID PUB VBI FID	18.523.305/0001-06	BB DTVM	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B	1.256.588.794,98	INDETERMINADO	D=1	MÉDIO PRAZO	2	BAIXO	0,200%
ICATU VANG. INFUSÃO CURBA	30.827.432/0001-03	ICATU VANGUARDIA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B 5	19.860.083,18	INDETERMINADO	D=1	MÉDIO PRAZO	2	BAIXO	0,400%
CAIXA FI BRASIL IMB-M 3 TITULOS PUBLICOS MF	33.780.670/0001-06	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B 5	54.413.767,42	INDETERMINADO	D=1	CURTO PRAZO	2	BAIXO	0,200%
BRADSECO FIC FID ALOCAÇÃO DINÂMICA	28.515.874/0001-09	BRAM - DTVM	ART. 7.º, IV, "a"	IPCA	260.315.400,06	INDETERMINADO	D=0	CURTO PRAZO	2	BAIXO	0,200%
SAFRA S&P REALS FID BVM	21.595.879/0001-54	SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA	ART. 8.º, II	CDI	119.518.128,10	INDETERMINADO	D=4	CURTO PRAZO	2	BAIXO	0,400%
BRADSECO FIC FID IMA B5	20.218.216/0001-04	BRAM - DTVM	ART. 7.º, IV, "a"	IMA-B 5	473.480.314,72	INDETERMINADO	D=1	MÉDIO PRAZO	3	MÉDIO	0,200%
CAIXA BR GESTÃO ESTRATÉGICA	23.215.097/0001-55	CAIXA ECONOMICA	ART. 7.º, IV, "a"	IPCA	458.510.373,12	INDETERMINADO	D=0	CURTO PRAZO	3	MÉDIO	1,000%
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP MF	22.791.028/0001-27	CAIXA ECONOMICA	ART. 7.º, I, "a"	IMA-B	44.868.805,48	16/06/2030	-	MÉDIO PRAZO	3	MÉDIO	1,000%
CAIXA FI BRASIL 2024 V TP MF	22.791.028/0001-26	CAIXA ECONOMICA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B	53.144.827,25	16/06/2034	-	LONGO PRAZO	3	MÉDIO	2,000%
SANTANDER IMA B INSTITUCIONAL FIC FID	14.548.526/0001-90	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B	92.510.332,31	INDETERMINADO	D=4	CURTO PRAZO	3	MÉDIO	0,200%
SANTANDER BRITISH FID ATRIBU FIC FID	26.507.132/0001-06	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, I, "b"	IPCA	621.561.444,03	INDETERMINADO	D=0	CURTO PRAZO	3	MÉDIO	0,400%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP MF	11.060.813/0001-10	CAIXA ECONOMICA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B 5	1.360.730.699,04	INDETERMINADO	D=1	CURTO PRAZO	3	MÉDIO	0,200%
SANTANDER FIC IMA B 5 TP MF	13.455.117/0001-03	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B 5	223.360.991,89	INDETERMINADO	D=13	CURTO PRAZO	4	ALTO	1,000%
BTG ABSOLUTO FID IMA	11.877.794/0001-64	BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	ART. 8.º, II, "a"	RODUESFA	99.245.905,86	INDETERMINADO	D=3	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,10% a 0,20%
CAIXA FIA CONSOLID	10.577.532/0001-79	CAIXA ECONOMICA	ART. 8.º, II, "a"	ICOM	-	INDETERMINADO	D=3	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,200%
FIC CAIXA CAPITAL PROTEGIDO	14.586.864/0001-10	CAIXA ECONOMICA	ART. 8.º, II	RODUESFA	-	31/12/2019	-	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,200%
ICATU DIVIDENDOS FIA	08.279.304/0001-43	ICATU VANGUARDIA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8.º, II, "a"	RODUESFA	272.795.418,19	INDETERMINADO	D=4	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,200%
ICATU ATRIBUIÇÃO CREDITO PRIVADO	18.719.272/0001-51	ICATU VANGUARDIA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, VII, "a"	IMA-B 5	13.362.845,11	INDETERMINADO	D=21	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,200%
BRADSECO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES MID-SMALL CAPS	08.988.433/0001-09	BRAM - DTVM	ART. 8.º, II, "a"	IBRX	83.794.675,82	INDETERMINADO	D=3	CURTO PRAZO	4	ALTO	1,500%
BR AÇÕES VALOR EQ FID EM AÇÕES	29.714.794/0001-38	BB DTVM	ART. 8.º, II, "a"	-	97.686.114,27	INDETERMINADO	D=32	CURTO PRAZO	4	ALTO	2,000%
BRADSECO FIC AÇÕES INSTITUCIONAL IMA ALPHA	14.099.976/0001-78	BRAM - DTVM	ART. 8.º, I, "a"	RODUESFA	31.087.522,09	INDETERMINADO	D=2	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,000%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FID RENDA FIA	30.628.348/0001-74	RAMO I - SAFRA S/A	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B	45.403.254,72	INDETERMINADO	D=4	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,200%
ICATU VANG. INFUSÃO LONGA	10.756.541/0001-06	ICATU VANGUARDIA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B 5+	111.209.977,41	INDETERMINADO	D=1	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,300%
ICATU VANG. IMA FID AÇÕES	08.214.270/0001-92	ICATU VANGUARDIA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8.º, I, "a"	RODUESFA	28.280.785,34	INDETERMINADO	D=4	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,10% a 0,80%
ITAU INSTIT ALOC DINÂMICA I	21.818.150/0001-49	ITALUBRANCO S/A	ART. 7.º, IV, "a"	IPCA	279.460.749,61	INDETERMINADO	D=1	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,300%
					1.364.948.262,53						

Quadro 48.

Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

CNPJ	GESTOR	ENQUADRAMENTO	BENCHMARK	SALDO	PRAZO DE DEBITAÇÃO DO ATIVO	PRAZO DE RESGATE	LAG BDEZ	VOLATILIDADE ATRIBUÍDA PELO ADMINISTRADOR	CONCEITO DA VOLATILIDADE REPRESENTADA (RISCO)	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO
13.327.340/0001-73	BB DTVM	ART. 7º, I, "b"	IMA-B 5+	13.030.296,77	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	2,500%
25.078.994/0001-90	BB DTVM	ART. 7º, I, "b"	IMA-B	951.811.398,87	INDETERMINADO	D+3	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	0,300%
01.699.688/0001-02	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8º, II, "a"	IBOVESPA	109.399.964,55	INDETERMINADO	D+3	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	0,750%
23.731.629/0001-07	ITALU UNIBANCO S/A	ART. 8º, II, "a"	IBOVESPA	164.487.751,26	INDETERMINADO	D+24	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	1,900%
29.549.642/0001-26	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8º, II, "a"	IBOVESPA	51.644.933,72	INDETERMINADO	D+29	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	2,00% a 2,50%
01.063.897/0001-65	ITALU UNIBANCO S/A	ART. 8º, II, "a"	IBOVESPA	57.227.707,88	INDETERMINADO	D+3	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	2,000%
24.571.992/0001-75	ITALU UNIBANCO S/A	ART. 8º, II, "a"	IBOVESPA	180.758.123,74	INDETERMINADO	D+24	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	1,500%
08.817.414/0001-10	ITALU UNIBANCO S/A	ART. 8º, II, "a"	IBOVESPA	10.512.308,42	INDETERMINADO	D+5	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	0,400%
02.436.763/0001-05	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8º, II, "a"	IBOVESPA	76.728.076,02	INDETERMINADO	D+4	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	0,500%
				1.615.600.563,23						
TOTAL				5.930.880.538,07						

Quadro 48-A

Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

VOLATILIDADE DA CARTEIRA COM BASE NA NOTA DE RISCO DO ADMINISTRADOR

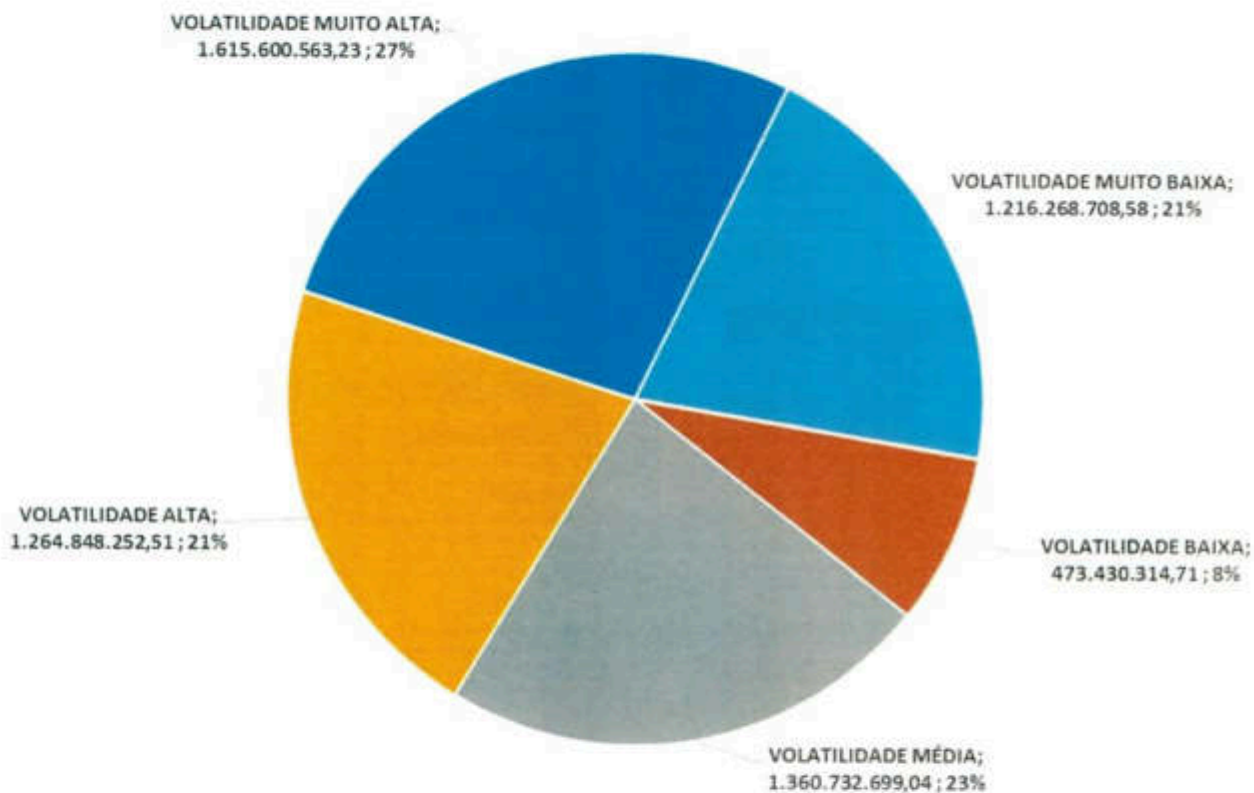


Gráfico 6.

Relatório de Investimentos – Janeiro/2020

17. VERIFICAÇÃO DE LASTRO DOS FUNDOS DE RISCO DE CRÉDITO

CREDITO INFLAÇÃO			
TABELA - DURATION & YIELD POR CLASSE			
Ativos	Duração	Yield	% P.
DEB	3,45	1,05%	58,1%
CR	0,00	0,00%	0,0%
LI	2,67	0,41%	11,6%
CDB	1,17	0,49%	1,6%
DPGE	0,00	0,00%	0,0%
NP	0,00	0,00%	0,0%
FIDC	0,00	0,00%	0,0%
NTN-B	3,38	-	23,5%
Over	0,00	-	7,2%
Carteira Crédito	3,27	0,93%	71,3%
Crédito - Contribuição Fundo	0,77	0,66%	71,3%
Fundo (Inclui DAP e NTN-B)	2,79	0,66%	100,0%

TABELA - RATING EXTERNO*		
Rating	Financiada	% P.
AAA	112.192.188	20,8%
AA+	80.438.603	14,9%
AA	91.256.263	16,9%
AA-	26.945.022	4,9%
A+	18.440.366	3,4%
DPGE	0	0,0%
A	11.811.696	2,2%
A-	14.017.205	2,6%
BBB+	14.831.530	2,7%
BBB	0	0,0%
BBB-	0	0,0%
BB+	15.282.090	2,8%
BB	0	0,0%
BB-	0	0,0%
B+	0	0,0%
B	0	0,0%
B-	0	0,0%
CCC	0	0,0%
CC	0	0,0%
C	0	0,0%
Sem Limite	0	0,0%
Tesouro / Over	154.901.126	28,7%
Total	539.532.569	100,0%

TABELA - SETOR		
Sector	Financiada	% P.
Elettrico	112.257.037	20,8%
Bancos	71.326.326	13,2%
Saneamento	40.156.108	7,4%
Conc. Rodovias	37.333.909	6,9%
Servico	25.391.632	4,7%
Óleo e Gas	15.807.084	2,9%
Shopping Center	15.625.174	2,9%
holding	15.615.941	2,9%
Mineração e Siderurgia	15.187.962	2,8%
Consumo	14.848.038	2,7%
Variejo	10.510.406	1,9%
Infraestrutura	4.514.791	0,8%
Papel e Celulose	3.243.604	0,6%
Logística	3.013.432	0,6%
Tesouro / Over	154.901.126	28,7%
Total	539.532.569	100,0%

TABELA - EMISSOR		
Emissor	Financiada	% P.
Eletrobras	20.042.198	3,7%
RIO PARANAPANEMA ENERGIA	15.402.192	2,9%
CEMIG D	15.282.090	2,8%
NATURA	14.648.038	2,7%
Rota das Bandeiras	14.017.205	2,6%
COPASA	12.668.123	2,3%
Lital	12.597.943	2,3%
Usiminas	11.851.656	2,2%
SABESP	10.950.266	2,0%
Banco FIDIS	10.757.788	2,0%
LOJAS AMERICANAS	10.510.406	1,9%
LOCALIZA	10.382.177	1,9%
CCR AUTOBAN	10.016.271	1,9%
Smurfit	9.902.837	1,8%
Bradesco	9.132.802	1,7%
AES TETE	8.816.354	1,6%
SANEPAR	8.548.869	1,6%
PETROBRAS	8.410.176	1,6%
Daycoval	8.325.492	1,5%
TAESA	8.229.244	1,5%
Águas de Guararoba	7.988.850	1,5%
COMGÁS	7.395.909	1,4%
COPEL	7.358.472	1,4%
MULTIFLAN	7.199.901	1,3%
Sofisa	6.880.000	1,3%
Alfa	5.734.600	1,1%
Safra	5.376.286	1,0%
Triângulo	5.307.219	1,0%
Itau	5.241.279	1,0%
Eneva	5.145.449	1,0%
Gerbau	4.514.791	0,8%
CCP	4.400.644	0,8%
REGIS BITTENCOURT	4.385.598	0,8%
TERMOPERNAMBUCO	4.174.041	0,8%
ECOVIAS	3.956.773	0,7%
EQUATORIAL	3.773.078	0,7%
BNB	3.709.677	0,7%
Dasa	3.551.913	0,7%
CPFL GERAÇÃO	3.509.476	0,7%
Volkswagen	3.356.399	0,6%
VALE	3.336.306	0,6%
Suzano	3.243.604	0,6%
Celpe	3.223.188	0,6%
Itausa	3.037.997	0,6%
MRS LOGISTICA	3.013.432	0,6%
Eletropaulo	3.010.375	0,6%
ABC Brasil	2.920.724	0,5%
ECORODOVIAS	2.794.673	0,5%
ENEL RJ	2.708.015	0,5%
Santo Antônio Energia	2.470.443	0,5%
ENEL CEARA	2.404.851	0,4%
ECOPISTAS	2.163.388	0,4%
Banreal	2.103.333	0,4%
EDP SAO PAULO	1.840.468	0,3%
Caixa	1.818.155	0,3%
BRMALLS	1.725.080	0,3%
Unidas	1.554.706	0,3%
EDP ESPIRITO SANTO	1.435.622	0,3%
CPFL RGE	1.411.068	0,3%
SONAS SIERRA	1.296.091	0,2%
CPFL Piratininga	1.211.854	0,2%
NGUATEMI	1.003.458	0,2%
COELBA	808.526	0,1%
Votorantim	642.988	0,1%
Tesouro / Over	154.901.126	28,7%
Total	539.532.569	100,0%

Quadro 49.

Nota: Acompanhamento de Verificação de Lastro relativo ao Título ou papel incluídos em operações estruturadas adquiridas por meio de veículos de investimento.

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 11 de fevereiro de 2020, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de janeiro/2020, com o acompanhamento da Rentabilidade e Risco das diversas modalidades de operações realizadas nas aplicações dos recursos do RPPS.

O Relatório da Carteira da Amazonprev reflete os resultados sobre as decisões de investimentos e alocações deliberadas no período, com base em análise de Cenário Econômico e Estratégia de Alocação proposta pelo Comitê de Investimentos devidamente alinhada aos termos da Política de Investimentos aprovada para o exercício atual.

Todas as operações efetuadas foram analisadas pelo Controles Internos, e, posteriormente, aprovadas pela Diretoria dessa Fundação Amazonprev.

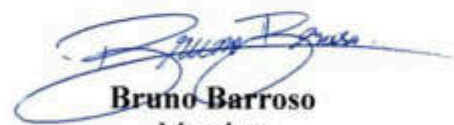
Manaus – AM, 11 de fevereiro de 2020.



Alan Nascimento
Coordenador



Bruno Costa Novo
Secretário



Bruno Barroso
Membro



Leonardo Cavalcanti
Membro



Andreza de Souza Silva
Membro



Claudinei Soares
Membro



André Luiz Bentes
Membro

APROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL - COFIS

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

() APROVAÇÃO

() REJEIÇÃO

Data:

Membros do Conselho Fiscal: