

Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

Processo: **2022.A.00761**

Destino: DIRAF / PRESI

Assunto: **Relatório de Investimentos – Janeiro/2022**

Data:

RELATÓRIO Nº. 008 / 2022 – COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **Janeiro/2022**, 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).

003

Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/02/2022 09:15:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/02/2022 09:23:37
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/02/2022 09:32:43

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/02/2022 15:07:36
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/02/2022 15:16:58
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2022 07:56:24
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/02/2022 08:19:39
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/02/2022 08:28:21

Documento assinado eletronicamente 118060/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEAMDYw



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% 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.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

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%



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

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

O início de 2022 foi marcado pelo aumento da tensão nos mercados devido às comunicações dos bancos centrais dos países desenvolvidos sobre a inflação. Tendo o FED como destaque que, além de indicar possíveis altas de juros, pode reduzir os ativos que detém em seu balanço. Isso pode significar uma redução do potencial de crescimento no local. Adicionalmente, temos ainda um mundo que está digerindo os impactos devido à desaceleração da China. O surto de Ômicron, por sua vez, contribuiu negativamente com esse ambiente, promovendo pressões do lado inflacionário e de atividade. Nesse sentido, os mercados de juros foram negativamente impactados no mundo, e ocorreu um descolamento da bolsa nos emergentes, causado alto fluxo em busca de prêmio.

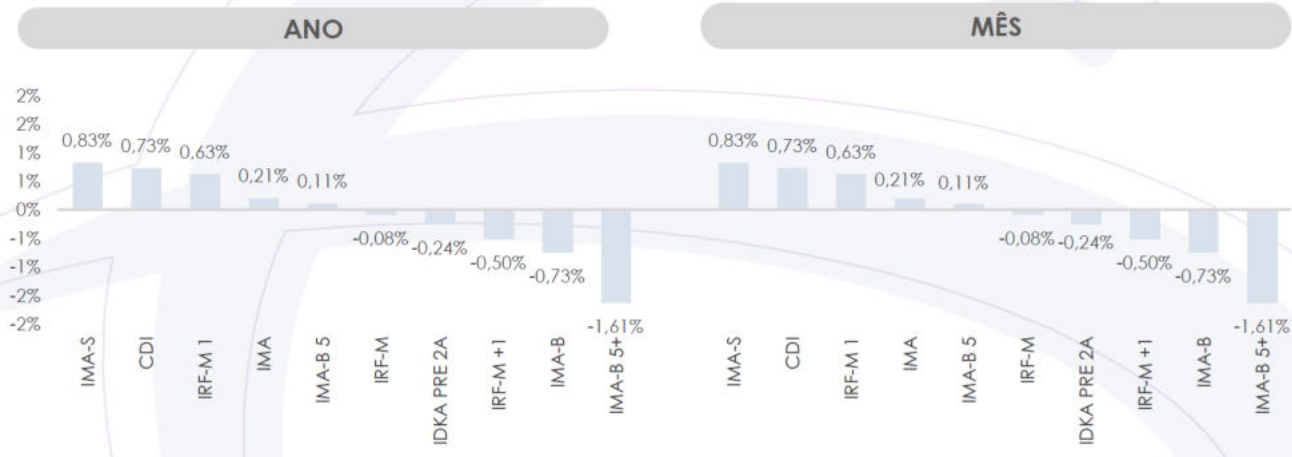
O cenário para as economias emergentes é desafiador. Além da incerteza de um viés de baixa da atividade global, temos para o Brasil um ano marcado pelo cenário eleitoral, que costuma ser volátil. Entretanto, seguimos tratando de dois desequilíbrios, o inflacionário, que tem chamado mais a atenção pelo amplo impacto no mundo, e a necessidade de retomada do ajuste fiscal. O inevitável aperto monetário mais elevado, conforme apontado pelo banco central, pode causar uma desaceleração da atividade econômica neste ano. A gestão da BRAM espera um PIB por volta de 0,4%, inflação de 5,2% e uma Selic de 11,75%.

Seguindo o desempenho dos ativos de renda fixa no mundo, percebemos um aumento em toda a estrutura de juros brasileira. Esse movimento pode ser explicado pela combinação de incerteza local, devido à dinâmica inflacionária e a necessidade crescente de um ajuste fiscal, com a incerteza sobre a condução de política monetária nos países desenvolvidos. Destaque positivo para o IMA-S, que representa os ativos de renda fixa do governo pós-fixados em Selic, tanto nominal quanto no relativo ao CDI. Mesmo com toda essa volatilidade, os índices IMA-B5 e IDKA IPCA 2a se mantiveram no campo positivo, porém abaixo do CDI.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA FIXA



Fonte: Carta do Gestor janeiro/2022 – BRAM.

Perspectivas Renda Variável

Janeiro foi marcado pela batalha entre as empresas classificadas como growth e as empresas value, gerando quedas expressivas na maioria das bolsas mundo afora. Economias aquecidas e inflação persistente têm motivado cada vez mais bancos centrais a promover ou sinalizar aumento de juros, que agora se intensifica nos países desenvolvidos, em especial nos EUA. As empresas consideradas como growth normalmente apresentam crescimento acima da média do mercado através do uso intensivo de tecnologia e maior dinamismo em sua atuação, proporcionando valorização expressiva principalmente em momentos de juros baixos pelo qual passamos nos últimos 2 anos. Porém, em momentos de aumento de taxas de juros, sua precificação passa a ser colocada em dúvida. No outro lado, estão as empresas value, que são mais tradicionais e maduras, têm preços mais modestos, resultados mais resilientes, são representadas tradicionalmente pelos bancos e empresas atreladas a commodities. Essas empresas oferecem mais proteção em ambientes inflacionários ou são beneficiadas em ambientes de taxas de juros mais altos.

Essa mudança de perspectivas motivou os investidores a rebalancear seus portfólios buscando proteção nas empresas value, não só nacionalmente, mas também internacionalmente em direção a países com forte exposição em bancos e commodities com é o caso da bolsa brasileira. Este evento tem sido denominado como rotação setorial. Com isso, o S&P 500 teve retorno de -5,26% e o MSCI Emerging Markets -1,93%. Estes índices acumulam retorno nos últimos 12 meses de +21,57% e -9,13%, respectivamente e em moeda original. Já o Brasil foi beneficiado pelo fluxo expressivo dos investidores estrangeiros em torno de R\$ 30 bilhões no mês, levando o Ibovespa a uma valorização de 6,98%, acumulando - 2,54% nos últimos 12 meses. A movimentação de fluxo no mês confirma a visão da gestão sobre a percepção de risco relativa e diferenciada entre os investidores locais e estrangeiros.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

Os gestores seguem 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 temos pela frente. Sobre a performance setorial, os setores cíclicos globais e locais como Mineração & Siderurgia, Energia e Imobiliário se destacaram positivamente impulsionados pelo fluxo estrangeiro. Por outro lado, setores que têm alguma relação com o movimento global de rotação setorial ou com a valorização do Real foram destaque negativo, como Bens de Capital & Serviços, Consumo, Tecnologia e Papel & Celulose.

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA VARIÁVEL

	JANEIRO	2021	12 MESES	24 MESES	36 MESES
S&P 500 USD	-5,26%	20,22%	21,57%	39,99%	66,99%
MSCI WORLD USD	-5,34%	13,72%	14,93%	30,59%	50,80%
SMLL CAPS	3,42%	-13,33%	-10,25%	-14,29%	24,49%
IBRX100	6,87%	-5,08%	-2,11%	-0,51%	18,37%
IDIV	7,47%	0,58%	5,96%	1,18%	28,50%
IBOVESPA	6,98%	-5,78%	-2,54%	-1,42%	15,14%

Fonte: Carta do Gestor fevereiro/2022 – BRAM.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

2.1. SALDOS E PERFORMANCE RENDA FIXA

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/12/2021	31/01/2022	nov/21	dez/21	jan/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB PREVID TP VII	R\$ 7.120.337,67	R\$ 7.160.519,06	1,7354	0,5826	0,5643	2,9055%	0,5643%	6,8622%	
BB PREVID IDKA 2	R\$ 300.635.822,30	R\$ 299.089.766,73	2,4291	0,7062	0,0096	3,1624%	0,0096%	4,4708%	
BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 271.047.525,22	R\$ 271.150.490,56	1,7339	0,9141	0,0379	2,7028%	0,0379%	0,1928%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 492.367.703,98	R\$ 462.797.410,61	2,4678	0,7674	0,0904	3,3475%	0,0904%	4,3201%	
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 53.538.599,32	R\$ 53.521.131,17	2,7100	0,8500	(0,0300)	3,5520%	-0,0300%	2,9100%	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 373.319.988,18	R\$ 375.812.297,44	0,9059	0,8257	0,6676	2,4183%	0,6676%	0,5325%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 93.399.609,36	R\$ 93.483.130,48	2,5000	0,7600	0,0900	3,3720%	0,0900%	4,1700%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 112.387.683,11	R\$ 110.544.136,50	4,4400	(0,3700)	(1,6400)	2,3471%	-1,6400%	-6,8800%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 133.951.797,73	R\$ 132.611.177,73	3,2400	(0,1000)	(1,0000)	2,1054%	-1,0000%	-4,2200%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 22.029,78	R\$ 22.144,86	1,6400	0,8600	0,5200	3,0472%	0,5200%	4,9300%	
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 1.837.791.096,65	R\$ 1.806.192.205,14							
BRABESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 75.287,33	R\$ 68.829,29	0,5700	0,6900	0,7500	2,0234%	0,7500%	4,6100%	
BRABESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 27.544.534,01	R\$ 17.287.027,71	0,6400	0,8100	0,7800	2,2465%	0,7800%	5,5900%	
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 27.619.821,34	R\$ 17.355.857,00							
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 29.159.159,12	R\$ 29.115.331,76	3,1800	1,1000	(0,1500)	4,1585%	-0,1500%	4,3400%	
SANTANDER CP CRESCIMENT INST	R\$ 107.652.513,38	R\$ 54.279.703,58	0,5966	0,7678	0,8012	2,1811%	0,8012%	6,2600%	
ITAU HIGH GRADE RF DP FIC FI	R\$ 61.624.409,75	R\$ 62.106.509,89	0,6400	0,8100	0,7800	2,2465%	0,7800%	5,8900%	
BTP PACTUAL CRED CORP FIC FI RF CP	R\$ 34.855.852,12	R\$ 35.165.043,34	0,6065	0,3388	0,8900	1,8458%	0,8900%	8,5100%	
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 34.040.408,86	R\$ 34.307.092,32	0,6800	0,8400	0,7800	2,3176%	0,7800%	6,8500%	
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 267.332.343,23	R\$ 214.973.680,89							
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 2.132.743.261,22	R\$ 2.038.521.743,03							

Quadro 1.

009
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/02/2022 09:15:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/02/2022 09:23:37
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/02/2022 09:32:44

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/02/2022 15:07:36
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/02/2022 15:16:58
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2022 07:56:24
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/02/2022 08:19:39
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/02/2022 08:28:21

Documento assinado eletronicamente 118060/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEAMDYw



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

2.2 SALDOS E PERFORMANCE RENDA VARIÁVEL

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/12/2021	31/01/2022	nov/21	dez/21	jan/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES	
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 38.807.964,00	R\$ 41.487.495,73	0,0600	3,4000	6,9000	10,6009%	6,9000%	3,1500%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 76.459.160,97	R\$ 78.411.922,52	(3,7900)	2,2200	2,5500	0,8537%	2,5500%	-5,6300%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 101.786.211,51	R\$ 105.536.227,31	(0,8673)	4,0767	3,6842	6,9752%	3,6842%	4,5901%	
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 50.145.820,90	R\$ 53.398.000,03	-	0,2900	6,4854	6,7942%	6,4854%	5,0335%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 152.999.296,21	R\$ 159.061.290,34	(3,1700)	3,8900	3,9600	4,5803%	3,9600%	-3,6900%	
BRASIL CAPITAL RP INSTIT FIC AÇÕES	R\$ 41.113.518,85	R\$ 42.805.434,68	(3,7300)	2,4200	4,1200	2,6620%	4,1200%	-19,3100%	
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 227.851.827,32	R\$ 239.252.584,89	(6,7100)	(0,6854)	5,0000	-2,7169%	5,0000%	-27,9300%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FI AÇÕES	R\$ 7.941.806,13	R\$ 2.029,54	(4,3200)	0,7000	5,2900	1,4467%	5,2900%	-11,5400%	
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANT	R\$ 11.997.742,88	R\$ 12.166.074,52	(0,5234)	5,7810	1,4030	6,7037%	1,4030%	11,0498%	
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 17.242.753,11	R\$ 18.494.062,10	(3,3841)	4,1938	7,2570	7,9732%	7,2570%	-10,3805%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 76.750.860,53	R\$ 82.023.716,52	(2,1900)	0,9300	6,8700	5,5017%	6,8700%	-9,0800%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 157.617.379,80	R\$ 159.732.366,10	(1,4400)	0,9700	1,3400	0,8495%	1,3400%	-5,9000%	
ITAU SMALL CAPS VALUATION	R\$ 104.186.789,94	R\$ 108.626.776,75	(2,3200)	3,5100	4,2600	5,4158%	4,2600%	-9,7800%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 80.861.753,24	R\$ 86.135.355,58	(2,6700)	3,4900	6,5200	7,2942%	6,5200%	-4,0500%	
SANTANDER CRESC SENIOR (TOP AÇÕES)	R\$ 12.327,77	R\$ 13.001,08	(4,1435)	2,1847	5,4600	3,2988%	5,4600%	-16,3400%	
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 97.670.543,70	R\$ 104.820.262,58	3,5100	0,1200	7,3200	11,2202%	7,3200%	-3,5400%	
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 22.605.221,39	R\$ 32.663.683,71	-	(0,7200)	-	-0,7200%	0,0000%	0,0000%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 38.984.655,51	R\$ 36.971.635,23	(0,6400)	2,6600	5,1400	7,2459%	5,1400%	-3,7400%	
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ -	R\$ 20.164.063,53	-	-	-	0,0000%	0,0000%	0,0000%	
TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ -	R\$ 20.197.000,00	-	-	-	0,0000%	0,0000%	0,0000%	
4UM SMALL CAPS FIA	R\$ -	R\$ 20.197.000,00	-	-	(1,3600)	-1,3600%	-1,3600%	0,8800%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 34.095.419,66	R\$ -	(2,0600)	1,8800	-	-0,2187%	0,0000%	0,0000%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 26.804.565,85	R\$ -	(5,6715)	4,9353	-	-1,0161%	0,0000%	0,0000%	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 8.130.314,94	R\$ 8.874.359,73	(2,7265)	3,7459	9,1515	10,1527%	9,1515%	-5,0500%	
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 1.374.065.934,21	R\$ 1.431.034.342,47							
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.374.065.934,21	R\$ 1.431.034.342,47							

Quadro 2.

2.3 SALDOS E PERFORMANCE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/12/2021	31/01/2022	nov/21	dez/21	jan/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 25.980.390,21	R\$ 23.653.098,34	(0,7968)	3,9956	(8,9578)	-6,0745%	-8,9578%	14,8670%	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 41.389.565,28	R\$ 36.748.774,99	(0,7084)	4,7214	(11,2100)	-7,6765%	-11,2100%	5,9150%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 34.417.308,95	R\$ 24.736.672,27	0,1499	(12,9547)	(28,1200)	-37,3380%	-28,1200%	-28,3947%	
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 154.235.894,63	R\$ 134.869.550,68	(2,0098)	0,8868	(12,5600)	-13,5575%	-12,5600%	2,3577%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 32.233.514,06	R\$ 28.642.634,43	(2,3300)	1,6400	(11,1400)	-11,7871%	-11,1400%	7,4300%	
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Ex	R\$ 288.256.673,13	R\$ 248.650.730,71							
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 168.086.619,73	R\$ 150.368.142,74	(1,2881)	2,9915	(10,5412)	-9,0518%	-10,5412%	13,6399%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 163.286.774,60	R\$ 144.140.131,06	0,2100	3,4500	(11,7300)	-8,4929%	-11,7300%	13,9400%	
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 331.373.394,33	R\$ 294.508.273,80							
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 619.630.067,46	R\$ 543.159.004,51							

Quadro 3.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

2.4 SALDOS E PERFORMANCE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2021	31/01/2022	nov/21	dez/21	jan/22	TRIMESTRE	2022	ULTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 28.619.821,87	R\$ 27.135.958,42	(0,5100)	5,4200	(5,1800)	-0,5505%	-5,1800%	25,4800%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 23.614.189,43	R\$ 29.920.524,49	-	-	(5,2000)	-5,2000%	-5,2000%	26,9000%
ITAÚ MM SP500 BRL FIC	R\$ 109.658.401,60	R\$ 103.861.011,00	(0,5100)	5,5400	(5,2900)	-0,5528%	-5,2900%	25,9500%
FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV FIM	R\$ -	R\$ 16.478.273,38	-	-	-	0,0000%	0,0000%	0,0000%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MM	R\$ -	R\$ 15.005.273,84	-	-	0,2100	0,2100%	0,2100%	0,2100%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 161.892.412,90	R\$ 192.401.041,13						
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 13.828.108,17	R\$ 15.362.665,89	(0,3007)	(0,3581)	(1,4600)	-2,1081%	-1,4600%	12,1500%
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.256.195,85	R\$ 9.206.341,55	(0,5050)	(0,5775)	(0,5400)	-1,6138%	-0,5400%	NC
TOTAL art. 10º, inciso II	R\$ 23.084.304,02	R\$ 24.569.007,44						
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 184.976.716,92	R\$ 216.970.048,57						
TOTAL GERAL	R\$ 4.311.415.979,81	R\$ 4.229.685.138,58						

Quadro 4.

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 neste mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. 182/2021, devidamente autorizada pela Diretoria: **Novos Recursos:** direcionar para os fundos BTG PACTUAL S&P 500 BRL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (36.499.594/0001-74) até o limite permitido nesse momento de 5% do PL do fundo, direcionando os demais repasses para Itaú Private MM SP500 BRL FICFI (26.269.692/0001-61). A decisão partiu da análise do estudo do ALM que sugere aumentar exposição em ativos descorrelacionados com os índices do mercado interno. A opção por esses ativos, além do fato de cumprirem os termos exigidos em Credenciamento, dá-se pelos resultados observados no período com a necessidade de manter os recursos enquadrados à legislação vigente. **Recursos Atuais: 1)** resgatar o valor de R\$ 15 milhões do fundo BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA (11.977.794/0001-64); zerar posição o fundo BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES (12.239.939/0001-92) e SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES (11.458.144/0001-02) e ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA (08.817.414/0001-10). Direcionar o valor total dos resgates, rateando entre os fundos: Tarpon GT 30 FIC FIA (35.726.741/0001-39), TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA (CNPJ: 36.671.926/0001-56) e 4UM SMALL CAPS FIA (09.599.197/0001-07). **2)** zerar a posição no fundo BTG Pactual Dividendos. Direcionar o saldo resgatado, rateando entre os fundos: TRIGONO DELPHOS INCOME FIC DE FIA (CNPJ: 29.088.410/0001-18) e 4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA (09.599.346/0001-22). **3)** resgatar 50% do valor aplicado no fundo SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST (17.138.474/0001-05) direcionando para o fundo Porto Seguro FI Ref. DI CP (18.719.154/0001-01).

Nota 3: As movimentações neste mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. 183/2022, devidamente autorizada pela Diretoria: **Resgatar** R\$ 30 milhões do fundo FI Caixa IMA B5, rateando entre os fundos Caixa Capital Protegido V e Rio Bravo Capital Protegido. Tais movimentações mantêm a diversificação da carteira, pois foram considerados os diversos segmentos de investimentos (Small, Dividendos, Valor e Capital Protegido), com maior descorrelação entre os fundos de mesmo segmento.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

012

2.5 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

INSTITUIÇÃO	nov/21	dez/21	jan/22
BRASESCO	R\$ 174.889.379,04	R\$ 180.619.117,55	R\$ 176.417.147,34
BANCO DO BRASIL	R\$ 909.888.397,22	R\$ 924.802.727,54	R\$ 910.356.244,77
CAIXA	R\$ 923.310.810,76	R\$ 954.838.223,79	R\$ 950.695.711,61
ITAÚ	R\$ 447.483.784,62	R\$ 467.204.430,53	R\$ 434.348.808,60
SANTANDER	R\$ 251.937.186,19	R\$ 261.900.735,78	R\$ 189.162.255,34
ICATU	R\$ 310.386.790,63	R\$ 311.697.312,12	R\$ 315.166.315,26
SAFRA	R\$ 316.086.209,87	R\$ 325.858.394,20	R\$ 303.887.267,21
BTG PACTUAL	R\$ 268.201.329,84	R\$ 293.733.789,59	R\$ 298.988.665,21
AZ QUEST	R\$ 74.798.444,07	R\$ 76.459.160,97	R\$ 78.411.922,52
OCCAM BRASIL	R\$ 78.132.767,17	R\$ 80.861.753,24	R\$ 86.135.355,58
SCHRODER	R\$ 31.713.226,62	R\$ 32.233.514,06	R\$ 28.642.634,43
SULAMÉRICA	R\$ 25.543.886,19	R\$ 26.804.565,85	R\$ -
PLURAL INVEST GESTÃO	R\$ 79.063.014,16	R\$ 75.806.874,23	R\$ 61.485.447,26
BRASIL CAPITAL	R\$ 40.140.785,00	R\$ 41.113.518,85	R\$ 42.805.434,68
BNP PARIBAS	R\$ 7.836.757,83	R\$ 8.130.314,94	R\$ 8.874.359,73
DAYCOVAL	R\$ 16.548.724,79	R\$ 17.242.753,11	R\$ 18.494.062,10
ARX	R\$ 37.533.248,57	R\$ 38.807.964,00	R\$ 41.487.495,73
MONGERAL	R\$ 25.973.110,33	R\$ 34.040.408,86	R\$ 34.307.092,32
VINCI PARTNERS	R\$ 131.806.769,22	R\$ 136.655.199,21	R\$ 141.791.897,81
GUEPARDO	R\$ -	R\$ 22.605.221,39	R\$ 32.663.683,71
TRÍGONO CAPITAL	R\$ -	R\$ -	R\$ 20.164.063,53
TARPON	R\$ -	R\$ -	R\$ 20.197.000,00
4UM INVESTIMENTOS	R\$ -	R\$ -	R\$ 20.197.000,00
RIO BRAVO	R\$ -	R\$ -	R\$ 15.005.273,84
TOTAL	R\$ 4.151.274.622,12	R\$ 4.311.415.979,81	R\$ 4.229.685.138,58

Quadro 4.

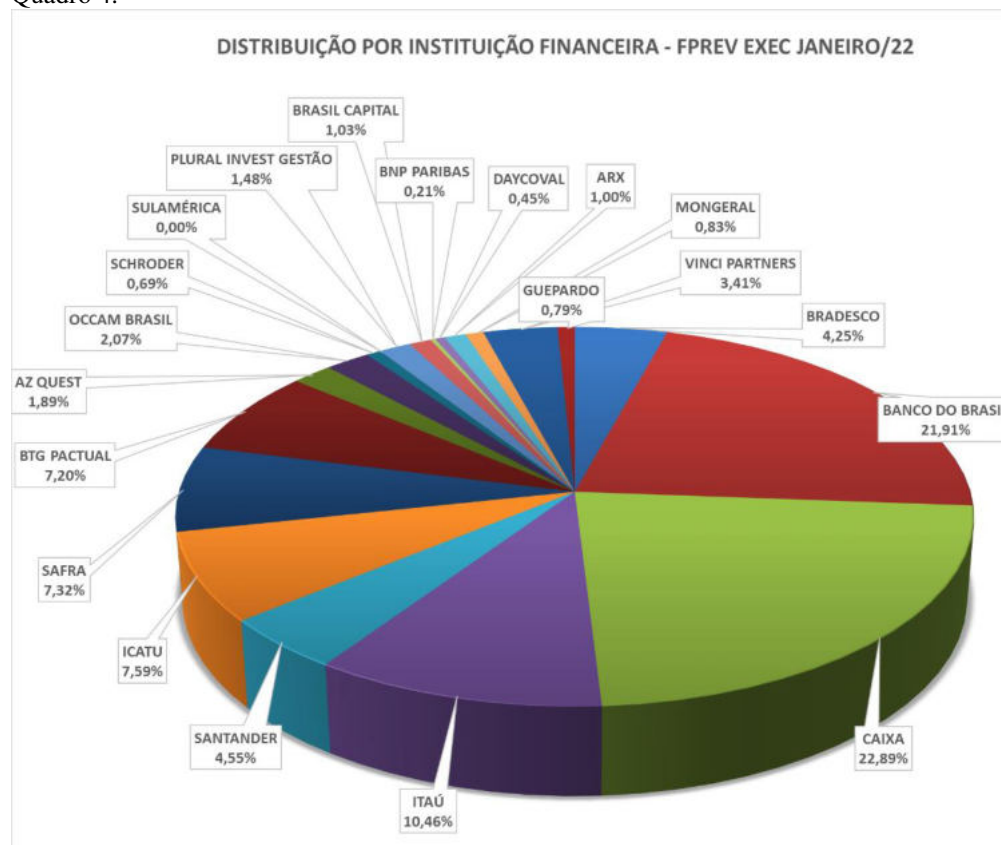


Gráfico 1.

Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/02/2022 09:15:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/02/2022 09:23:37
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/02/2022 09:32:44

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/02/2022 15:07:36
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/02/2022 15:16:58
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2022 07:56:24
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/02/2022 08:19:39
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/02/2022 08:28:21

Documento assinado eletronicamente 118060/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEAMDYw



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

2.6 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2021	31/01/2022	nov/21	dez/21	jan/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 178.402.400,81	R\$ 180.306.719,65	1,4796	1,2584	1,0674	3,853%	1,0674%	17,5320%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 186.354.128,20	R\$ 188.360.975,64	1,4891	1,2679	1,0769	3,883%	1,0769%	17,6643%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 192.047.125,84	R\$ 194.160.777,13	1,5129	1,2916	1,1006	3,956%	1,1006%	17,9956%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 193.535.218,10	R\$ 195.619.429,28	1,4891	1,2679	1,0769	3,883%	1,0769%	17,6645%
TOTAL GERAL	R\$ 750.338.872,95	R\$ 758.447.901,70						

Quadro 5.

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

2.7 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\$ 180.306.719,65	R\$ 188.360.975,64	R\$ 194.160.777,13	R\$ 195.619.429,28
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.

2.8 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	31/12/2021	31/01/2022
CVS - A	R\$ 1.048.518,02	R\$ 1.031.667,99
CVS - B	R\$ 6.783.585,05	R\$ 6.674.495,15
CVS - C	R\$ 136.015,88	R\$ 133.830,06
CVS - D	R\$ 743.910,42	R\$ 731.947,26
TOTAL	R\$ 8.712.029,37	R\$ 8.571.940,46

Quadro 7.

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

2.9 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/21	R\$ 25.234,67	R\$ 145.243,31	R\$ 170.477,98
TOTAL	R\$ 25.234,67	R\$ 145.243,31	R\$ 170.477,98

Quadro 8.

013

Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/02/2022 09:15:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/02/2022 09:23:37
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/02/2022 09:32:44

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/02/2022 15:07:36
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/02/2022 15:16:58
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2022 07:56:24
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/02/2022 08:19:39
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/02/2022 08:28:21

Documento assinado eletronicamente 118060/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEAMDYw



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

014

2.10 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2022 (Contrato Regular)			
MÊS	UEA	SEAS	TOTAL
jan/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ -	R\$ -	R\$ -

Quadro 9.

2.11 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	31/12/2021	31/01/2022	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.311.415.979,81	R\$ 4.229.685.138,58	82,4915%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 750.338.872,95	R\$ 758.447.901,70	14,7920%
TÍTULOS CVS	R\$ 8.712.029,37	R\$ 8.571.940,46	0,1672%
IMÓVEIS	R\$ 68.293.435,00	R\$ 68.293.435,00	1,3319%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 174.185,24	R\$ 62.422.047,44	1,2174%
TOTAL	R\$ 5.138.934.502,37	R\$ 5.127.420.463,18	100,00%

Quadro 10.

2.12 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
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\$ 5.138.934.502,37	3,21%	6,88%	6,88%
jan/22	R\$ 5.127.420.463,18	-0,22%	-0,22%	9,29%

Quadro 11.

Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/02/2022 09:15:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/02/2022 09:23:37
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/02/2022 09:32:44

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/02/2022 15:07:36
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/02/2022 15:16:58
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2022 07:56:24
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/02/2022 08:19:39
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/02/2022 08:28:21

Documento assinado eletronicamente 118060/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEAMDYw



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

015

2.13 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

1. Investimentos - Executivo

Saldo dos Investimentos em 01/2021		R\$ 4.691.638.612,35	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
02/2021	R\$ 40.864.605,59	R\$ 44.974.382,51	R\$ -4.109.776,92
03/2021	R\$ 41.485.170,47	R\$ 10.665.619,53	R\$ 30.819.550,94
04/2021	R\$ 41.308.639,76	R\$ 10.074.221,86	R\$ 31.234.417,90
05/2021	R\$ 41.318.216,48	R\$ 14.353.928,89	R\$ 26.964.287,59
06/2021	R\$ 50.044.250,01	R\$ 10.611.950,64	R\$ 39.432.299,37
07/2021	R\$ 47.181.791,70	R\$ 9.896.860,10	R\$ 37.284.931,60
08/2021	R\$ 26.480.105,00	R\$ 11.394.062,81	R\$ 15.086.042,19
09/2021	R\$ 41.572.477,52	R\$ 10.674.589,38	R\$ 30.897.888,14
10/2021	R\$ 43.880.558,88	R\$ 10.627.718,85	R\$ 33.252.840,03
11/2021	R\$ 54.114.701,48	R\$ 14.772.501,88	R\$ 39.342.199,60
12/2021	R\$ 94.087.378,25	R\$ 11.974.925,91	R\$ 82.112.452,34
01/2022	R\$ 15.009.670,47	R\$ 10.463.470,04	R\$ 4.546.200,43
Saldo dos Investimentos em 01/2022		R\$ 5.127.420.463,18	

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

Taxa de Juros Anual	4,9500 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	10,3794 %	0,5400 %	0,5400 %
Juros	4,9500 %	0,4034 %	0,4034 %
Meta	15,8432 %	0,9456 %	0,9456 %
Rentabilidade em %	1,4256 %	-0,2384 %	-0,2384 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 68.918.517,62	R\$ -12.240.517,88	R\$ -12.240.517,88
Resultado em %	-12,4458 %	-1,1729 %	-1,1729 %
Resultado em R\$	R\$ -696.350.407,89	R\$ -60.798.450,48	R\$ -60.798.450,48

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.

Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/02/2022 09:15:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/02/2022 09:23:37
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/02/2022 09:32:44

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/02/2022 15:07:36
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/02/2022 15:16:58
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2022 07:56:24
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/02/2022 08:19:39
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/02/2022 08:28:21

Documento assinado eletronicamente 118060/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEAMDYw



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

016

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/12/2021	31/01/2022	nov/21	dez/21	jan/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 5.181.412,73	R\$ 5.216.004,16	0,9059	0,8257	0,6676	2,4183%	0,6676%	0,5325%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 91.089,75	R\$ 91.565,58	1,6400	0,8600	0,5200	3,0472%	0,5200%	4,9300%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FI RF LP	R\$ 75.497,45	R\$ 74.259,03	4,4400	(0,3700)	(1,6400)	2,3471%	-1,6400%	-6,8800%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 75.590,14	R\$ 74.833,62	3,2400	(0,1000)	(1,0000)	2,1054%	-1,0000%	-4,2200%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 364.732,60	R\$ 364.767,72	2,4291	0,7062	0,0096	3,1624%	0,0096%	4,4708%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 5.788.322,67	R\$ 5.821.430,11						
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 2.036.309,03	R\$ 2.033.248,36	3,1800	1,1000	(0,1500)	4,1585%	-0,1500%	4,3400%
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 165.527,34	R\$ 166.995,67	-	0,3388	0,8900	1,2318%	0,8900%	8,5100%
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 2.201.836,37	R\$ 2.200.244,03						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 7.990.159,04	R\$ 8.021.674,14						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/12/2021	31/01/2022	nov/21	dez/21	jan/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 441.840,95	R\$ 472.195,83	(2,1900)	0,9300	6,8700	5,5017%	6,8700%	-9,0800%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 1.097.665,91	R\$ 1.152.588,55	(6,7100)	(0,6854)	5,0000	-2,7169%	5,0000%	-27,9300%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT	R\$ 478.650,33	R\$ 485.365,93	(0,5234)	5,7810	1,4030	6,7037%	1,4030%	11,0498%
OCCAM FIC FIA	R\$ 1.869.922,31	R\$ 1.991.874,01	(2,6700)	3,4900	6,5200	7,2942%	6,5200%	-4,0500%
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 109.838,06	R\$ 114.358,14	(3,7300)	2,4200	4,1200	2,6620%	4,1200%	-19,3100%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 3.997.917,56	R\$ 4.216.382,46						
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 3.997.917,56	R\$ 4.216.382,46						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/12/2021	31/01/2022	nov/21	dez/21	jan/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 1.699.304,75	R\$ 1.500.048,07	0,2100	3,4500	(11,7300)	-8,4929%	-11,7300%	13,9400%
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 1.699.304,75	R\$ 1.500.048,07						
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.699.304,75	R\$ 1.500.048,07						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2021	31/01/2022	nov/21	dez/21	jan/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 786.452,84	R\$ 745.677,30	(0,5100)	5,4200	(5,1800)	-0,5505%	-5,1800%	25,4800%
ITAÚ MM SP500 BRL FIC	R\$ 170.527,33	R\$ 161.511,94	(0,5100)	5,5400	(5,2900)	-0,5528%	-5,2900%	25,9500%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 956.980,17	R\$ 907.189,24						
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 956.980,17	R\$ 907.189,24						

TOTAL GERAL	R\$ 14.644.361,52	R\$ 14.645.293,91						
--------------------	--------------------------	--------------------------	--	--	--	--	--	--

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 330.496,56						
TOTAL RECURSOS		R\$ 14.975.790,47						

Quadro 13.

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2021	31/01/2022	nov/21	dez/21	jan/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.554.337,82	R\$ 2.582.450,61	1,5129	1,2916	1,1006	4,6899%	1,1006%	17,9956%
TOTAL GERAL	R\$ 2.554.337,82	R\$ 2.582.450,61						

Quadro 14.

Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/02/2022 09:15:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/02/2022 09:23:37
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/02/2022 09:32:44

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/02/2022 15:07:36
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/02/2022 15:16:58
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2022 07:56:24
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/02/2022 08:19:39
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/02/2022 08:28:21

Documento assinado eletronicamente 118060/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEAMDYw



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

3.3 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	31/12/2021	31/01/2022
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 7.990.159,04	R\$ 8.021.674,14
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 3.997.917,56	R\$ 4.216.382,46
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.699.304,75	R\$ 1.500.048,07
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.554.337,82	R\$ 2.582.450,61
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 330.496,56
TOTAL	R\$ 16.241.719,17	R\$ 16.651.051,84

Quadro 15.

3.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

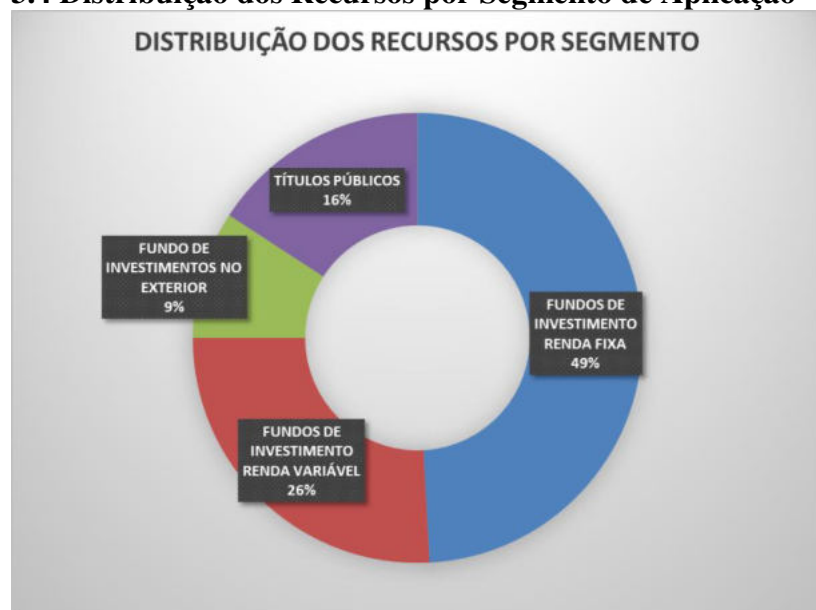


Gráfico 3.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

3.5 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

1. Investimentos - Assembléia

Saldo dos Investimentos em 01/2021		R\$ 15.410.641,43	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
02/2021	R\$ 143.097,24	R\$ 0,00	R\$ 143.097,24
03/2021	R\$ 143.973,76	R\$ 0,00	R\$ 143.973,76
04/2021	R\$ 144.001,52	R\$ 0,00	R\$ 144.001,52
05/2021	R\$ 144.070,46	R\$ 0,00	R\$ 144.070,46
06/2021	R\$ 144.136,78	R\$ 0,00	R\$ 144.136,78
07/2021	R\$ 174.168,74	R\$ 0,00	R\$ 174.168,74
08/2021	R\$ 152.615,42	R\$ 0,00	R\$ 152.615,42
09/2021	R\$ 152.252,38	R\$ 0,00	R\$ 152.252,38
10/2021	R\$ 165.653,56	R\$ 0,00	R\$ 165.653,56
11/2021	R\$ 169.762,40	R\$ 0,00	R\$ 169.762,40
12/2021	R\$ 164.966,52	R\$ 0,00	R\$ 164.966,52
01/2022	R\$ 330.496,56	R\$ 0,00	R\$ 330.496,56
Saldo dos Investimentos em 01/2022		R\$ 17.227.744,52	

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

Taxa de Juros Anual	4,9500 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	10,3794 %	0,5400 %	0,5400 %
Juros	4,9500 %	0,4034 %	0,4034 %
Meta	15,8432 %	0,9456 %	0,9456 %
Rentabilidade em %	-1,3062 %	-1,7528 %	-1,7528 %
Rentabilidade em R\$	R\$ -212.092,25	R\$ -301.451,38	R\$ -301.451,38
Resultado em %	-14,8040 %	-2,6731 %	-2,6731 %
Resultado em R\$	R\$ -2.780.637,18	R\$ -464.083,24	R\$ -464.083,24

Quadro 16.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

4.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2021	31/01/2022	nov/21	dez/21	jan/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 7.679.290,50	R\$ 7.730.557,95	0,9059	(0,8257)	0,6676	0,7408%	0,6676%	0,5325%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 40.540.838,53	R\$ 40.637.207,13	1,4500	0,7800	0,2400	2,4867%	0,2400%	0,6700%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 78.696.812,90	R\$ 78.726.708,18	1,7339	0,9141	0,0379	2,7028%	0,0379%	0,1928%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 3.289.156,56	R\$ 3.289.473,36	2,4291	0,7062	0,0096	3,1624%	0,0096%	4,4708%
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 1.664.692,02	R\$ 1.677.603,63	0,6400	0,8100	0,7800	2,2465%	0,7800%	5,5900%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FIA RF	R\$ 1.626.133,37	R\$ 1.609.858,66	3,2400	(0,1000)	(1,0000)	2,1054%	-1,0000%	-4,2200%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 133.496.923,88	R\$ 133.671.408,91						

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2021	31/01/2022	nov/21	dez/21	jan/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 23.288.292,57	R\$ 24.909.888,95	(3,5900)	2,8700	6,9600	6,0797%	6,9600%	-6,2800%
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.296.125,92	R\$ 1.349.464,48	(3,7300)	2,4200	4,1200	2,6620%	4,1200%	-19,3100%
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 7.543.030,69	R\$ 7.151.944,14	(0,5100)	5,4200	(5,1800)	-0,5505%	-5,1800%	25,4800%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ -	R\$ 1.896.463,46	-	-	3,0800	3,0800%	3,0800%	NC
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 2.215.232,34	0,0000%	0,0000%	13,2100	13,2100%	13,2100%	NC
BB AÇOES VALOR	R\$ 21.002.458,48	R\$ 21.776.232,75	(0,8673)	4,0767	3,6842	6,9752%	3,6842%	4,5901%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 53.129.907,66	R\$ 59.299.226,12						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 3.913.565,18	R\$ 1.169,74
TOTAL RECURSOS	R\$ 190.540.396,72	R\$ 192.971.804,77

Quadro 17.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

1. Investimentos - Ministério Público

Saldo dos Investimentos em 01/2021		R\$ 170.277.337,76	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
02/2021	R\$ 1.585.217,06	R\$ 1.642,15	R\$ 1.583.574,91
03/2021	R\$ 1.564.682,30	R\$ 17.772,47	R\$ 1.546.909,83
04/2021	R\$ 1.594.346,58	R\$ 9.707,31	R\$ 1.584.639,27
05/2021	R\$ 1.573.220,64	R\$ 41.257,15	R\$ 1.531.963,49
06/2021	R\$ 1.959.057,05	R\$ 12.521,07	R\$ 1.946.535,98
07/2021	R\$ 2.023.578,91	R\$ 55.617,86	R\$ 1.967.961,05
08/2021	R\$ 1.638.039,45	R\$ 23.802,84	R\$ 1.614.236,61
09/2021	R\$ 1.647.557,59	R\$ 3.779,70	R\$ 1.643.777,89
10/2021	R\$ 1.646.387,89	R\$ 23.802,84	R\$ 1.622.585,05
11/2021	R\$ 3.285.936,72	R\$ 81.114,00	R\$ 3.204.822,72
12/2021	R\$ 3.913.495,83	R\$ 32.084,33	R\$ 3.881.411,50
01/2022	R\$ 1.169,74	R\$ 0,00	R\$ 1.169,74
Saldo dos Investimentos em 01/2022		R\$ 192.971.804,77	

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

Taxa de Juros Anual	4,9500 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	10,3794 %	0,5400 %	0,5400 %
Juros	4,9500 %	0,4034 %	0,4034 %
Meta	15,8432 %	0,9456 %	0,9456 %
Rentabilidade em %	0,3141 %	1,2754 %	1,2754 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 564.878,97	R\$ 2.430.238,31	R\$ 2.430.238,31
Resultado em %	-13,4053 %	+0,3267 %	+0,3267 %
Resultado em R\$	R\$ -27.882.652,07	R\$ +628.477,66	R\$ +628.477,66

Quadro 18.

020
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/02/2022 09:15:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/02/2022 09:23:37
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/02/2022 09:32:44

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/02/2022 15:07:36
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/02/2022 15:16:58
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2022 07:56:24
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/02/2022 08:19:39
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/02/2022 08:28:21

Documento assinado eletronicamente 118060/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEAMDYw



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2021	31/01/2022	nov/21	dez/21	jan/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGIA	R\$ 7.837.552,85	R\$ 7.889.876,88	0,9059	0,8257	0,6676	2,4183%	0,6676%	1,5127%
BRASESCO INST. ALOC. DINAMICA	R\$ 8.641.653,63	R\$ 8.662.195,49	1,4500	0,7800	0,2400	2,4867%	0,2400%	0,6700%
BRASESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 9.569.604,29	R\$ 9.522.704,65	2,4700	0,7700	0,0800	3,3416%	0,0800%	3,7600%
BRASESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 1.174.869,42	R\$ 1.183.981,89	0,6400	0,8100	0,7800	2,2465%	0,7800%	5,5900%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 1.147.674,78	R\$ 1.136.188,59	3,2400	(0,1000)	(5,1800)	-2,2057%	-5,1800%	25,4800%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 2.093.873,16	R\$ 2.094.074,83	2,4291	0,7062	0,0096	3,1624%	0,0096%	4,4708%
TOTAL	R\$ 30.465.228,13	R\$ 30.489.022,33						

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2021	31/01/2022	nov/21	dez/21	jan/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 871.525,63	R\$ 907.390,92	(3,7300)	2,4200	4,1200	2,6620%	4,1200%	-19,3100%
BRASESCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	R\$ 846.661,14	R\$ 905.615,34	(3,5900)	2,8700	6,9600	6,0797%	6,9600%	-6,2800%
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 3.761.909,47	R\$ 3.566.864,23	(0,5100)	5,4200	(1,0000)	3,8335%	-1,0000%	-4,2200%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 14.740,24	R\$ 14.947,05	(0,5234)	5,7810	1,4030	6,7037%	1,4030%	11,0498%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.734.677,14	R\$ 1.838.134,89	-	(0,7200)	5,9600	5,1971%	5,9600%	
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 1.734.806,69	R\$ 1.641.787,40	-	-	(5,3600)	-5,3600%	-5,3600%	
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 8.964.320,31	R\$ 8.874.739,83						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 12.723,57
TOTAL RECURSOS	R\$ 39.429.548,44	R\$ 39.376.485,73

Quadro 19.

021

Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/02/2022 09:15:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/02/2022 09:23:37
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/02/2022 09:32:44

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/02/2022 15:07:36
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/02/2022 15:16:58
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2022 07:56:24
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/02/2022 08:19:39
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/02/2022 08:28:21

Documento assinado eletronicamente 118060/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEAMDYw



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

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	R\$ 6.283,41	R\$ 77.294,71	R\$ -71.011,30
02/2021	R\$ 1.003.038,47	R\$ 51.465,27	R\$ 951.573,20
03/2021	R\$ 992.747,96	R\$ 51.465,27	R\$ 941.282,69
04/2021	R\$ 999.548,81	R\$ 39.463,54	R\$ 960.085,27
05/2021	R\$ 1.057.911,85	R\$ 96.855,31	R\$ 961.056,54
06/2021	R\$ 1.062.228,59	R\$ 51.465,27	R\$ 1.010.763,32
07/2021	R\$ 1.085.187,70	R\$ 51.462,27	R\$ 1.033.725,43
08/2021	R\$ 1.172.401,85	R\$ 51.465,27	R\$ 1.120.936,58
09/2021	R\$ 1.179.063,91	R\$ 12.001,73	R\$ 1.167.062,18
10/2021	R\$ 1.172.130,12	R\$ 51.465,27	R\$ 1.120.664,85
11/2021	R\$ 1.220.800,58	R\$ 90.180,34	R\$ 1.130.620,24
12/2021	R\$ 3.547.742,31	R\$ 80.855,04	R\$ 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.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

023

6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2021	31/01/2022	nov/21	dez/21	jan/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 163.955.412,81	R\$ 165.049.990,12	0,9059	0,8257	0,6676	2,4183%	0,6676%	0,5325%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 51.597.045,77	R\$ 51.616.646,42	1,7339	0,9141	0,0379	2,7028%	0,0379%	0,1928%
BB PREV RF IDKA 2	R\$ 171.305.703,28	R\$ 171.322.202,67	2,4291	0,7062	0,0096	3,1624%	0,0096%	4,4708%
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 1.572.013,64	R\$ 1.248.326,91	0,6400	0,8100	0,7800	2,2465%	0,7800%	5,5900%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 1.847.985,00	R\$ 1.829.489,94	3,2400	(0,1000)	(1,0000)	2,1054%	-1,0000%	-4,2200%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 41.360.457,88	R\$ 41.391.569,26	2,4700	0,7700	0,0800	3,3416%	0,0800%	3,7600%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 431.638.618,38	R\$ 432.458.225,32						
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2021	31/01/2022	nov/21	dez/21	jan/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 2.829.052,97	R\$ 2.945.475,00	(3,7300)	2,4200	4,1200	2,6620%	4,1200%	-19,3100%
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 20.068.461,87	R\$ 19.027.964,24	(0,5100)	5,4200	(5,1800)	-0,5505%	-5,1800%	25,4800%
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 4.155.004,91	R\$ 4.444.323,71	(3,5900)	2,8700	6,9600	6,0797%	6,9600%	-6,2800%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 9.286.178,35	R\$ 9.416.465,99	(0,5234)	5,7810	1,4030	6,7037%	1,4030%	11,0498%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 2.959.907,11	R\$ 4.921.931,09	-	(0,7200)	8,4800	7,6989%	8,4800%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 2.960.078,94	R\$ 4.849.980,01	-	-	5,1400	5,1400%	5,1400%	-3,7400%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 42.258.684,15	R\$ 45.606.140,04						
FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2021	31/01/2022	nov/21	dez/21	jan/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 31.652.771,81	R\$ 28.817.354,87	(0,7968)	3,9956	(8,9578)	-6,0745%	-8,9578%	14,8670%
TOTAL - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 31.652.771,81	R\$ 28.817.354,87						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1.268.056,82	R\$ 3.818.920,03						
TOTAL	R\$ 506.818.131,16	R\$ 510.700.640,26						

Quadro 21.

Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/02/2022 09:15:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/02/2022 09:23:37
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/02/2022 09:32:44

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/02/2022 15:07:36
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/02/2022 15:16:58
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2022 07:56:24
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/02/2022 08:19:39
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/02/2022 08:28:21

Documento assinado eletronicamente 118060/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEAMDYw



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

6.2 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

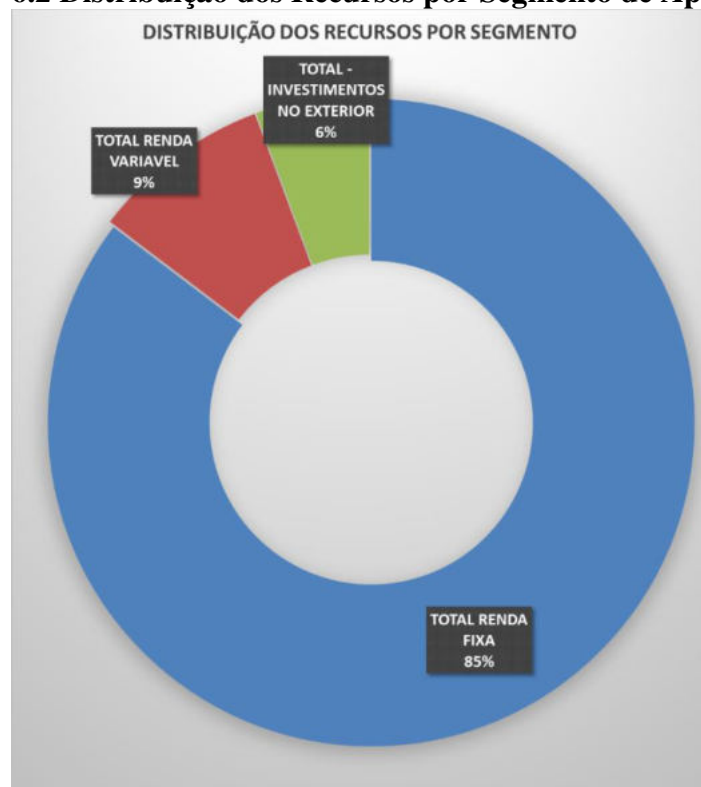


Gráfico 4.

6.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Justiça

Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
02/2021	RS 3.471.253,44	RS 284.979,37	RS 3.186.274,07
03/2021	RS 3.427.904,40	RS 367.719,45	RS 3.060.184,95
04/2021	RS 3.574.036,92	RS 317.977,95	RS 3.256.058,97
05/2021	RS 3.591.371,99	RS 308.689,08	RS 3.282.682,91
06/2021	RS 3.620.988,47	RS 346.178,51	RS 3.274.809,96
07/2021	RS 3.670.676,51	RS 315.553,25	RS 3.355.123,26
08/2021	RS 3.690.680,27	RS 318.681,54	RS 3.371.998,73
09/2021	RS 3.738.023,51	RS 317.532,32	RS 3.420.491,19
10/2021	RS 3.756.511,37	RS 317.532,32	RS 3.438.979,05
11/2021	RS 3.805.215,10	RS 331.580,86	RS 3.473.634,24
12/2021	RS 7.253.729,28	RS 456.014,72	RS 6.797.714,56
01/2022	RS 5.672.474,97	RS 302.640,83	RS 5.369.834,14
Saldo dos Investimentos em 01/2021			RS 454.420.914,99
Saldo dos Investimentos em 01/2022			RS 510.700.640,26

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

Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	10,3794 %	0,5400 %	0,5400 %
Juros	4,9500 %	0,4034 %	0,4034 %
Meta	15,8432 %	0,9456 %	0,9456 %
Rentabilidade em %	2,3259 %	-0,2935 %	-0,2935 %
Rentabilidade em R\$	RS 10.991.939,24	RS -1.487.325,04	RS -1.487.325,04
Resultado em %	-11,6686 %	-1,2275 %	-1,2275 %
Resultado em R\$	RS -63.812.781,05	RS -6.279.825,64	RS -6.279.825,64

Quadro 22.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2021	31/01/2022	nov/21	dez/21	jan/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 42.018.824,25	R\$ 42.299.344,72	0,9059	0,8257	0,6676	2,4183%	0,6676%	0,5325%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 32.039.840,92	R\$ 32.042.926,85	2,4291	0,7062	0,0096	3,1624%	0,0096%	4,4708%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 21.423.676,45	R\$ 21.431.814,86	1,7339	0,9141	0,0379	2,7028%	0,0379%	0,1928%
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 304.436,43	R\$ 306.797,69	0,6400	0,8100	0,7800	2,2465%	0,7800%	5,5900%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 297.747,60	R\$ 294.767,67	3,2400	(0,1000)	(1,0000)	2,1054%	-1,0000%	-4,2200%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 7.677.996,48	R\$ 7.683.771,85	2,4700	0,7700	0,0800	3,3416%	0,0800%	3,7600%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 103.762.522,13	R\$ 104.059.423,64						
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2021	31/01/2022	nov/21	dez/21	jan/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 764.303,19	R\$ 795.756,03	(3,7300)	2,4200	4,1200	2,6620%	4,1200%	-19,3100%
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 3.744.251,95	R\$ 3.550.122,20	(0,5100)	5,4200	(5,1800)	-0,5505%	-5,1800%	25,4800%
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 441.891,72	R\$ 472.661,25	(3,5900)	2,8700	6,9600	6,0797%	6,9600%	-6,2800%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT.	R\$ 9.286.178,35	R\$ 9.416.465,99	(0,5234)	5,7810	1,4030	6,7037%	1,4030%	11,0498%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 859.592,91	R\$ 910.859,82	-	(1,8900)	5,9600	3,9574%	5,9600%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 859.642,80	R\$ 903.809,47	-	-	5,1400	5,1400%	5,1400%	-3,7400%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 15.955.860,92	R\$ 16.049.674,76						
FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2021	31/01/2022	nov/21	dez/21	jan/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 605.378,59	R\$ 551.149,51	(0,7968)	3,9956	(8,9578)	-6,0745%	-8,9578%	14,8670%
TOTAL - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 605.378,59	R\$ 551.149,51						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 4.958,52						
TOTAL	R\$ 120.323.761,64	R\$ 120.665.206,43						

Quadro 23.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

7.2 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

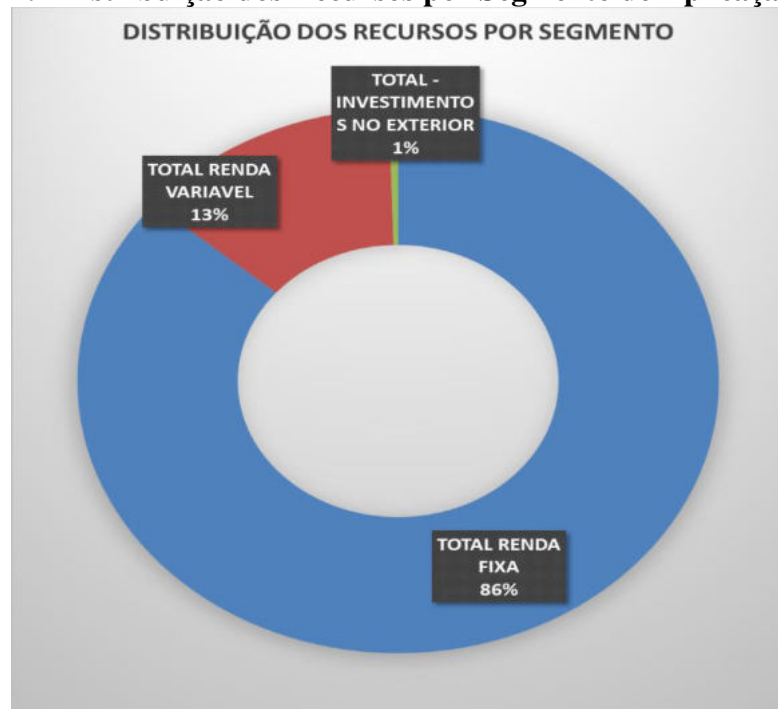


Gráfico 5.

7.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Contas

Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
02/2021	R\$ 1.040.178,80	R\$ 0,00	R\$ 1.040.178,80
03/2021	R\$ 523.658,87	R\$ 0,00	R\$ 523.658,87
04/2021	R\$ 4.964,70	R\$ 0,00	R\$ 4.964,70
05/2021	R\$ 1.036.389,86	R\$ 67.687,34	R\$ 968.702,52
06/2021	R\$ 521.558,25	R\$ 32.206,97	R\$ 489.351,28
07/2021	R\$ 523.292,11	R\$ 39.670,93	R\$ 483.621,18
08/2021	R\$ 587.761,57	R\$ 32.116,97	R\$ 555.644,60
09/2021	R\$ 596.685,79	R\$ 32.206,97	R\$ 564.478,82
10/2021	R\$ 621.603,17	R\$ 7.463,96	R\$ 614.139,21
11/2021	R\$ 1.288.278,50	R\$ 56.027,71	R\$ 1.232.250,79
12/2021	R\$ 1.716.449,08	R\$ 39.670,93	R\$ 1.676.778,15
01/2022	R\$ 4.958,52	R\$ 0,00	R\$ 4.958,52
Saldo dos Investimentos em 01/2021			R\$ 111.482.483,64
Saldo dos Investimentos em 01/2022			R\$ 120.665.206,43

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

Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	10,3794 %	0,5400 %	0,5400 %
Juros	4,9500 %	0,4034 %	0,4034 %
Meta	15,8432 %	0,9456 %	0,9456 %
Rentabilidade em %	0,8907 %	0,2797 %	0,2797 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 1.023.995,35	R\$ 336.486,27	R\$ 336.486,27
Resultado em %	-12,9075 %	-0,6597 %	-0,6597 %
Resultado em R\$	R\$ -17.175.647,70	R\$ -801.301,95	R\$ -801.301,95

Quadro 24.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV

1. Investimentos - CONSOLIDADO

Saldo dos Investimentos em 01/2021		R\$ 5.468.436.480,49	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
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
01/2022	R\$ 21.018.770,26	R\$ 10.807.477,47	R\$ 10.211.292,79
Saldo dos Investimentos em 01/2022		R\$ 6.008.362.344,89	

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

Taxa de Juros Anual	4,9500 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	10,3794 %	0,5400 %	0,5400 %
Juros	4,9500 %	0,4034 %	0,4034 %
Meta	15,8432 %	0,9456 %	0,9456 %
Rentabilidade em %	1,4451 %	-0,1876 %	-0,1876 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 81.633.943,37	R\$ -11.274.265,83	R\$ -11.274.265,83
Resultado em %	-12,4290 %	-1,1226 %	-1,1226 %
Resultado em R\$	R\$ -812.531.630,13	R\$ -68.099.727,78	R\$ -68.099.727,78

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 GERAF/COFIN, para o exercício de 2021.

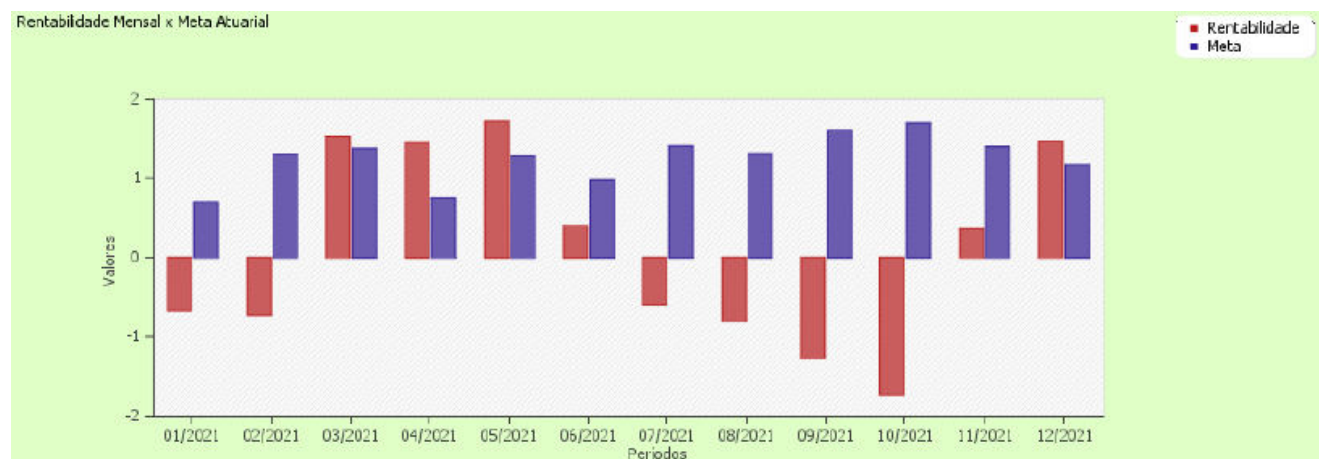


Gráfico 6.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

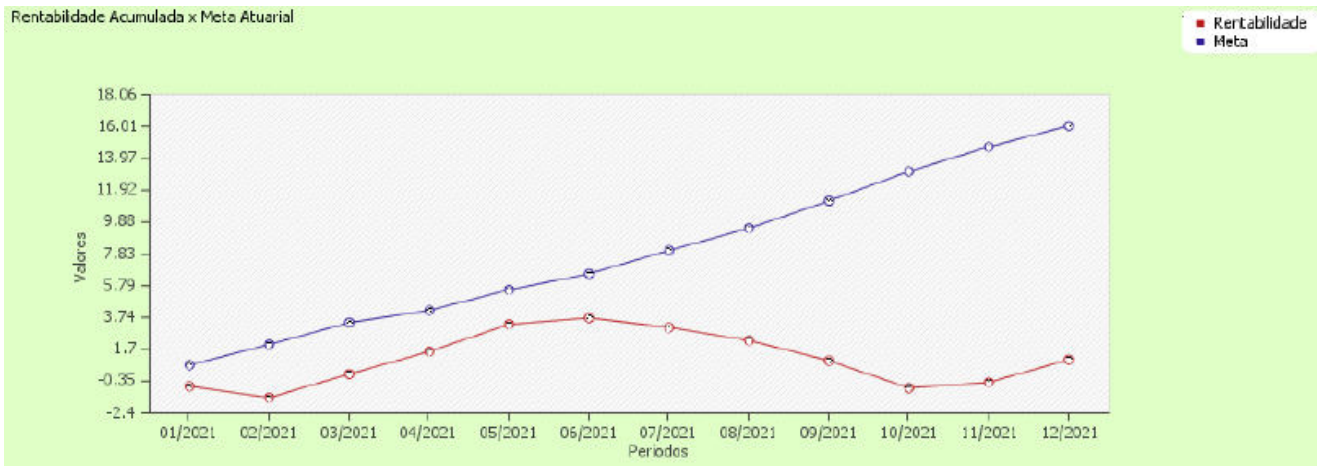


Gráfico 7.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/12/2021	31/01/2022
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 20.700.266,91	R\$ 1.772.737,98
FUNDO BRADESCO RF - COMPREV	R\$ 6.259.794,93	R\$ 6.385.738,48
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 0,02	R\$ 311.235,80
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 3.320.989,92	R\$ 18.636.853,65
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 264.295,10	R\$ 243.392,44
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 23.432.002,70	R\$ 2,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - COMPREV	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 53.977.349,58	R\$ 27.349.960,35

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	
	31/12/2021	31/01/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R\$ 24.930.709,80	R\$ 16.022,46
BRADESCO DI PREMIUM - FPPM	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R\$ 453,96	R\$ 1,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ 24.806,63	R\$ 24.806,63
TOTAL	R\$ 24.955.970,39	R\$ 40.830,09

Quadro 27.

Nota: Com base nos termos da LC 206/2020 que, dentre outros, cria o Fundo Temporário - FTEMP a partir dos recursos de contribuição dos servidores militares do FPREV, com finalidade de pagamento dos inativos e pensionistas do FFIN e do FPPM.

9.3 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/12/2021	31/01/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 803.859,92	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 301,07
TOTAL	R\$ 803.859,92	R\$ 301,07

Quadro 28.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

030

9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/12/2021	31/01/2022
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 451.032,00	R\$ 634.726,93
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 2.075,62	R\$ 62.807,05
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 453.108,62	R\$ 697.534,98

Quadro 29.

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/12/2021	31/01/2022
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 3.172.933,30	R\$ 8.176.912,68
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 6.066.281,79	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 9.239.215,09	R\$ 8.176.913,68

Quadro 30.

9.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/12/2021	31/01/2022
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 12.279.664,11	R\$ 15.687.359,01
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 547.786,19	R\$ -
TOTAL	R\$ 12.827.450,30	R\$ 15.687.359,01

Quadro 31.

9.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/12/2021	31/01/2022
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 6.709.308,76	R\$ 2.531.002,50
DISPONIBILIDADE COBERTURA TCE FFIN	R\$ 705,87	R\$ 705,87
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 6.710.014,63	R\$ 2.531.709,37

TOTAL GERAL FFIN	R\$ 108.966.968,53	R\$ 54.484.608,55
-------------------------	---------------------------	--------------------------

Quadro 32.

Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/02/2022 09:15:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/02/2022 09:23:37
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/02/2022 09:32:44

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/02/2022 15:07:36
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/02/2022 15:16:58
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2022 07:56:24
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/02/2022 08:19:39
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/02/2022 08:28:21

Documento assinado eletronicamente 118060/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEAMDYw



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

031

10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/12/2021	31/01/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.143,62	R\$ 1.031.235,79
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 40.560.407,77	R\$ 39.331.318,82
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ -
TOTAL	R\$ 40.561.552,39	R\$ 40.362.554,61

Quadro 33.

10.2 Taxa de Administração - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/12/2021	31/01/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 35.718,27	R\$ -
TOTAL	R\$ 35.718,27	R\$ -

Quadro 34.

10.3 Taxa de Administração - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/12/2021	31/01/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 61.970,46	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ -
TOTAL	R\$ 61.971,46	R\$ -

Quadro 35.

10.4 Taxa de Administração – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/12/2021	31/01/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 605.835,00	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 158.635,06
TOTAL	R\$ 605.835,00	R\$ 158.635,06

Quadro 36.

10.5 Taxa de Administração – PGJ/MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/12/2021	31/01/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 199.434,03	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 199.434,03	R\$ -

TOTAL GERAL	R\$ 41.464.511,15	R\$ 40.521.189,67
--------------------	--------------------------	--------------------------

Quadro 37.

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/02/2022 15:07:36
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/02/2022 15:16:58
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2022 07:56:24
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/02/2022 08:19:39
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/02/2022 08:28:21

Documento assinado eletronicamente 118060/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEAMDYw



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

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 2022		Resolução CMN nº 4.963/21
			ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE SUPERIOR	
TÍTULOS DO TESOUREO NACIONAL	R\$ 761.030.352,30	12,81%	30,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
TOTAL art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 761.030.352,30				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 7.160.519,06	41,07%	9,00%	100,00%	art. 7º, Inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 508.203.212,16				
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 422.925.660,02				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 462.797.410,61				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 53.521.131,17				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 643.329.390,09				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 93.483.130,48				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 110.618.395,53				
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 137.556.316,21				
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 113.710,44				
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 2.439.708.875,77				
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 30.464.615,13	2,79%	5,00%	70,00%	art. 7º, inciso III, "a"
BRADERCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 27.543.687,82				
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.598.045,76				
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 49.299.402,62				
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 165.905.751,33				
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 31.148.580,12	3,66%	5,00%	10,00%	art 7º, inciso V, "b"
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 54.279.703,58				
ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 62.106.509,89				
BTP PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 35.332.039,01				
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 34.307.092,32				
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 217.173.924,92				
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 3.583.818.904,32	60,33%			

Quadro 38.

Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/02/2022 09:15:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/02/2022 09:23:37
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/02/2022 09:32:44
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/02/2022 15:07:36
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/02/2022 15:16:58
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2022 07:56:24
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/02/2022 08:19:39
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/02/2022 08:28:21

Documento assinado eletronicamente 118060/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEAMDYw



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

033

11.2 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Variável

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2022		Resolução CMN nº 4.963/21
			ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 30.732.489,25	25,72%	40,00%	40,00%	art. 8º, inciso I
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 41.487.495,73				
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 78.411.922,52				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 127.312.460,06				
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 53.398.000,03				
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 8.874.359,73				
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 159.061.290,34				
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 48.917.879,25				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 240.405.173,44				
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 2.029,54				
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 31.499.319,48				
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.494.062,10				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 82.495.912,35				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 159.732.366,10				
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ -				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 108.626.776,75				
OCCAM FIC FIA	R\$ 88.127.229,59				
SANTANDER CRESCE SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 13.001,08				
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ -				
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 104.820.262,58				
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 42.549.841,85				
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 42.725.424,71				
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 20.164.063,53				
TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 20.197.000,00				
4UM SMALL CAPS FIA	R\$ 20.197.000,00				
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 1.528.245.360,01				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.528.245.360,01	25,72%			

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 2022		Resolução CMN nº 4.963/21
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 53.021.602,72	4,68%	5,00%	10,00%	art 9º-A, inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 36.748.774,99				
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 24.736.672,27				
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 134.869.550,68				
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 28.642.634,43				
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 278.019.235,09				
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	R\$ 150.368.142,74	4,98%	5,00%		art 9º-A, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NÍVEL I	R\$ 145.640.179,13				
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 296.008.321,87				
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 574.027.556,96	9,66%			

Quadro 40.

Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/02/2022 09:15:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/02/2022 09:23:37
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/02/2022 09:32:44

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/02/2022 15:07:36
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/02/2022 15:16:58
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2022 07:56:24
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/02/2022 08:19:39
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/02/2022 08:28:21

Documento assinado eletronicamente 118060/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEAMDYw



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

11.4 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Investimentos no Exterior

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2022		Resolução CMN nº 4.963/21
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 61.178.530,53	3,87%	5,00%	10,00%	art. 10º, inciso I
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 33.458.775,32				
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 104.022.522,94				
FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$ 16.478.273,38				
RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$ 15.005.273,84				
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 230.143.376,01				
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 15.362.665,89	0,41%	2,00%	5,00%	art. 10º, inciso II
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.206.341,55				
TOTAL art. 10º, inciso II	R\$ 24.569.007,44				
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 254.712.383,45	4,29%			
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 5.940.804.204,74	100%			

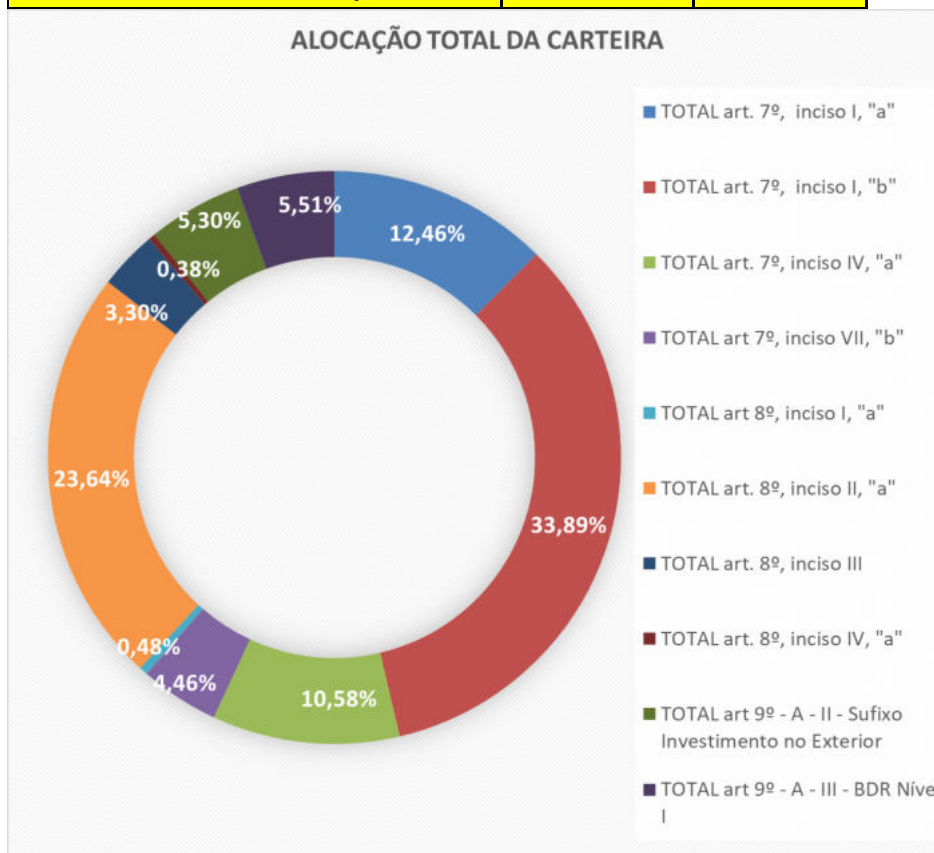


Gráfico 8.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

035

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO		TOTAL APLICADO	% CARTEIRA	LIMITE NO PL DO RPPS POR FUNDO
FI RF - 100% TPF	BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 7.160.519,06	0,12%	100%
	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 508.203.212,16	8,33%	
	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 422.925.660,02	6,93%	
	CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 462.797.410,61	7,58%	
	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 53.521.131,17	0,88%	
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 643.329.390,09	10,54%	
	ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 93.483.130,48	1,53%	
	ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 110.618.395,53	1,81%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 137.556.316,21	2,25%		
FI RENDA FIXA	BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 30.464.615,13	0,50%	20%
	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 27.543.687,82	0,45%	
	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.598.045,76	0,96%	
	BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 49.299.402,62	0,81%	
	ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 113.710,44	0,00%	
FI RF CREDITO PRIVADO	ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 31.148.580,12	0,51%	20%
	SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 54.279.703,58	0,89%	
	ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 62.106.509,89	1,02%	
	BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 35.332.039,01	0,58%	
	MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 34.307.092,32	0,56%	
FUNDOS DE AÇÕES	BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 30.732.489,25	0,50%	20%
	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 41.487.495,73	0,68%	
	AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 78.411.922,52	1,28%	
	BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 127.312.460,06	2,09%	
	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 53.398.000,03	0,87%	
	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 8.874.359,73	0,15%	
	BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 159.061.290,34	2,61%	
	BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 48.917.879,25	0,80%	
	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 240.405.173,44	3,94%	
	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 2.029,54	0,00%	
	CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 31.499.319,48	0,52%	
	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.494.062,10	0,30%	
	ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 82.495.912,35	1,35%	
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 159.732.366,10	2,62%	
	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ -	0,00%	
	ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 108.626.776,75	1,78%	
	OCCAM FIC FIA	R\$ 88.127.229,59	1,44%	
	SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 13.001,08	0,00%	
	SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ -	0,00%	
	VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 104.820.262,58	1,72%	
	GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 42.549.841,85	0,70%	
	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 42.725.424,71	0,70%	
	TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 20.164.063,53	0,33%	
TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 20.197.000,00	0,33%		
4UM SMALL CAPS FIA	R\$ 20.197.000,00	0,33%		
INVEST NO EXTERIOR - FI	BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 53.021.602,72	0,87%	20%
	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 36.748.774,99	0,60%	
	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 24.736.672,27	0,41%	
	SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 134.869.550,68	2,21%	
	SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 28.642.634,43	0,47%	
FIA - BDR	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 150.368.142,74	2,46%	20%
	SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 145.640.179,13	2,39%	
FUNDOS MULTIME RCADO	SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 61.178.530,53	1,00%	20%
	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 33.458.775,32	0,55%	
	ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 104.022.522,94	1,70%	
	FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$ 16.478.273,38	0,27%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$ 15.005.273,84	0,25%	
FIP	BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 15.362.665,89	0,25%	20%
	BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.206.341,55	0,15%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO		R\$ 5.179.773.852,44		

Quadro 41.

Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/02/2022 09:15:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/02/2022 09:23:37
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/02/2022 09:32:44

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/02/2022 15:07:36
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/02/2022 15:16:58
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2022 07:56:24
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/02/2022 08:19:39
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/02/2022 08:28:21

Documento assinado eletronicamente 118060/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEAMDYw



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO		TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL DO FUNDO	LIMITE RESOL. CMN 4.963/21		
FI RF - 100% TPF	BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 7.160.519,06	R\$ 248.037.532,98	2,89%	100%		
	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 508.203.212,16	R\$ 9.277.694.744,55	5,48%			
	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 422.925.660,02	R\$ 7.701.081.218,58	5,49%			
	CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 462.797.410,61	R\$ 12.444.051.491,75	3,72%			
	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 53.521.131,17	R\$ 218.489.919,55	24,50%			
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 643.329.390,09	R\$ 12.561.638.596,69	5,12%			
	ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 93.483.130,48	R\$ 824.519.977,45	11,34%			
	ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 110.618.395,53	R\$ 604.309.300,74	18,30%			
FI RENDA FIXA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 137.556.316,21	R\$ 1.091.655.164,39	12,60%	15%		
	BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 30.464.615,13	R\$ 631.584.812,26	4,82%			
	BRADERCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 27.543.687,82	R\$ 3.276.976.164,01	0,84%			
	BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.598.045,76	R\$ 1.241.205.562,42	4,72%			
FI RF CREDITO PRIVADO	BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 49.299.402,62	R\$ 1.152.512.113,97	4,28%	5%		
	ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 113.710,44	R\$ 2.626.754.965,66	0,00%			
	ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 31.148.580,12	R\$ 1.086.649.624,61	2,87%			
	SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 54.279.703,58	R\$ 1.904.562.600,94	2,85%			
FUNDOS DE AÇÕES	ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 62.106.509,89	R\$ 1.907.070.007,57	3,26%	15%		
	BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 35.332.039,01	R\$ 1.489.078.560,45	2,37%			
	MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 34.307.092,32	R\$ 777.989.992,71	4,41%			
	BRADERCO INST IBR X ALPHA	R\$ 30.732.489,25	R\$ 503.177.927,29	6,11%			
	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 41.487.495,73	R\$ 873.571.747,14	4,75%			
	AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 78.411.922,52	R\$ 1.900.035.039,47	4,13%			
	BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 127.312.460,06	R\$ 1.098.659.963,05	11,59%			
	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 53.398.000,03	R\$ 1.417.181.864,81	3,77%			
	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 8.874.359,73	R\$ 205.904.381,47	4,31%			
	BRADERCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 159.061.290,34	R\$ 1.419.483.989,90	11,21%			
	BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 48.917.879,25	R\$ 476.428.583,05	10,27%			
	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 240.405.173,44	R\$ 1.896.702.011,80	12,67%			
	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 2.029,54	R\$ 87.352.824,95	0,00%			
	CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 31.499.319,48	R\$ 732.439.572,24	4,30%			
	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.494.062,10	R\$ 154.789.214,50	11,95%			
	ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 82.495.912,35	R\$ 999.787.061,37	8,25%			
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 159.732.366,10	R\$ 2.631.453.374,95	6,07%			
	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ -	R\$ 723.867.535,77	0,00%			
	ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 108.626.776,75	R\$ 923.668.055,52	11,76%			
	OCCAM FIC FIA	R\$ 88.127.229,59	R\$ 1.010.020.909,77	8,73%			
	SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 13.001,08	R\$ 166.923.439,39	0,01%			
	SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ -	R\$ 368.066.288,15	0,00%			
	VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 104.820.262,58	R\$ 1.094.729.532,50	9,57%			
	GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 42.549.841,85	R\$ 703.850.641,65	6,05%			
	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 42.725.424,71	R\$ 542.903.933,54	7,87%			
	TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 20.164.063,53	R\$ 148.995.078,36	13,53%			
	TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 20.197.000,00	R\$ 371.387.178,09	5,44%			
	4UM SMALL CAPS FIA	R\$ 20.197.000,00	R\$ 422.779.606,93	4,78%			
	INVEST NO EXTERIOR - FI	BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 53.021.602,72	R\$ 2.529.172.574,05		2,10%	15%
		GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 36.748.774,99	R\$ 135.056.267.739,99		0,03%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		R\$ 24.736.672,27	R\$ 37.339.613.996,37	0,07%			
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR		R\$ 134.869.550,68	R\$ 2.180.881.081,62	6,18%			
FIA - BDR	SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 28.642.634,43	R\$ 18.014.220.675,90	0,16%	15%		
	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 150.368.142,74	R\$ 2.396.743.051,17	6,27%			
FUNDOS MULTIMERCADO	SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 145.640.179,13	R\$ 3.983.843.860,12	3,66%	15%		
	SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 61.178.530,53	R\$ 2.394.295.587,10	2,56%			
	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 33.458.775,32	R\$ 385.338.764,40	8,68%			
	ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 104.022.522,94	R\$ 2.374.573.482,34	4,38%			
	FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$ 16.478.273,38	R\$ 118.783.455,34	13,87%			
FIP	RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$ 15.005.273,84	R\$ 126.304.954,06	11,88%	15%		
	BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 15.362.665,89	R\$ 1.104.452.809,75	1,39%			
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO		R\$ 5.179.773.852,44					

Quadro 42.

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;



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

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 DEZEMBRO/2021) EM R\$ MI	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (JANEIRO/22)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 4.963/21
BB DTVM S.A	R\$ 1.364.292,83	R\$ 1.322.389.596,79	0,0969%	5%
CAIXA DTVM	R\$ 437.927,54	R\$ 1.207.625.524,73	0,2758%	
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 493.740,27	R\$ 434.601.886,12	0,0880%	
BANCO SAFRA	R\$ 103.874,03	R\$ 344.375.025,87	0,3315%	
BRADESCO	R\$ 540.605,40	R\$ 355.699.530,92	0,0658%	
ICATÚ VANGUARDA	R\$ 34.852,98	R\$ 317.746.018,48	0,9117%	
BANCO BTG	R\$ 209.016,99	R\$ 333.767.024,75	0,1597%	
BANCO SANTANDER	R\$ 300.776,23	R\$ 189.162.255,34	0,0629%	
VINCI PARTNERS	R\$ 42.784,99	R\$ 147.545.687,29	0,3449%	
OCCAM BRASIL GESTÃO	R\$ 14.298,75	R\$ 88.127.229,59	0,6163%	
PLURAL INVEST (GENIAL)	R\$ 40.256,66	R\$ 61.485.447,26	0,1527%	
AZ QUEST INVESTIMENTOS	R\$ 16.497,98	R\$ 78.411.922,52	0,4753%	
BC GESTAO RECURSOS LTDA	R\$ 6.987,05	R\$ 48.917.879,25	0,7001%	
ARX INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 36.179,05	R\$ 41.487.495,73	0,1147%	
SCHRODER	R\$ 24.043,74	R\$ 28.642.634,43	0,1191%	
MONGERAL AEGON	R\$ 8.401,46	R\$ 34.307.092,32	0,4083%	
SUL AMERICA INVESTIMENTOS	R\$ 29.223,22	R\$ -	0,0000%	
DAYCOVAL	R\$ 7.993,66	R\$ 18.494.062,10	0,2314%	
GUEPARDO	R\$ 1.657,24	R\$ 42.549.841,85	2,5675%	
4UM INVESTIMENTOS	R\$ 2.041,64	R\$ 20.197.000,00	0,9893%	
TRIGONO	R\$ 2.411,50	R\$ 20.164.063,53	0,8362%	
TARPON	R\$ 5.730,42	R\$ 20.197.000,00	0,3525%	
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	R\$ 9.245,72	R\$ 15.005.273,84	0,1623%	
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	R\$ 57.093,61	R\$ 8.874.359,73	0,0155%	

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.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

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

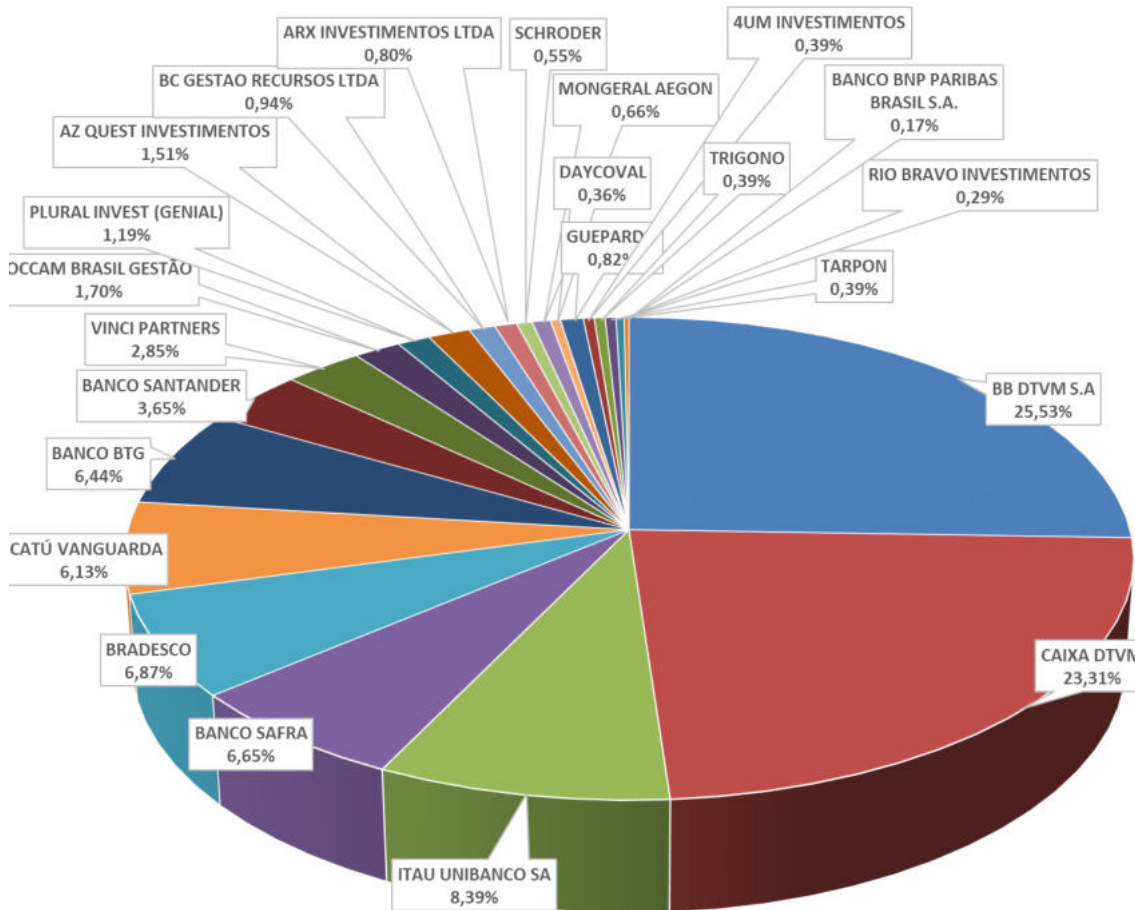


Gráfico 9.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 5.179.773.852,47
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 761.030.352,31
TÍTULOS - CVS	R\$ 8.571.940,46
IMÓVEIS	R\$ 68.293.435,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 86.029.059,43
TOTAL	R\$ 6.103.698.639,67

Quadro 44.

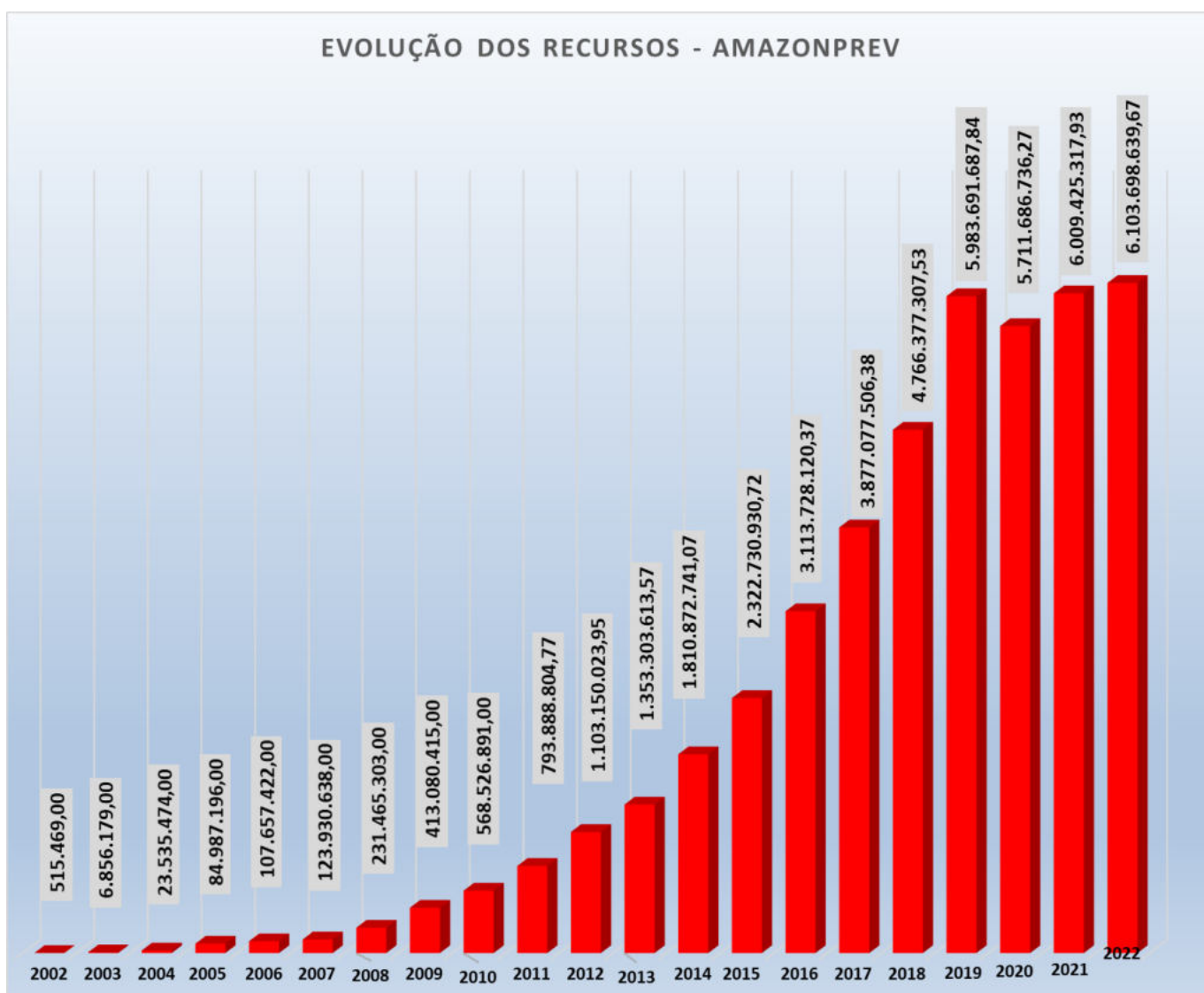


Gráfico 10.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

040

13. PLANO DE AÇÃO MENSAL

	PLANO DE AÇÃO MENSAL	RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV EXECUTIVO:	<p>a) Novos Recursos: Ratear entre os fundos PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO (CNPJ: 18.719.154/0001-01), ITAÚ HIGH GRADE RF CRÉDITO PRIVADO FIC (CNPJ: 09.093.883/0001-04) e BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC DE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO (CNPJ: 14.171.644/0001-57)</p> <p>b) Recursos Atuais: 1.1. Resgatar R\$ 30 milhões do fundo ITAÚ DUNAMIS FIC FIA (CNPJ: 24.571.992/0001-75), rateando o respectivo montante entre os fundos TARPON GT 30 FIC FIA (CNPJ: 35.726.741/0001-39), GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA (38.280.883/0001-03), OCCAM FIC FIA (11.628.883/0001-03) e ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA (CNPJ: 38.027.169/0001-08). 1.2 Resgatar R\$ 30 milhões do fundo BRADESCO FIA MID SMALL CAPS (CNPJ: 06.988.623/0001-09), rateando o respectivo montante entre os fundos TARPON GT 30 FIC FIA (CNPJ: 35.726.741/0001-39), GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA (38.280.883/0001-03), OCCAM FIC FIA (11.628.883/0001-03) e ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA (CNPJ: 38.027.169/0001-08). 1.3. Resgatar R\$ 6 milhões do fundo BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI AÇÕES (CNPJ: 11.977.794/0001-64), rateando o respectivo montante entre os fundos TARPON GT 30 FIC FIA (CNPJ: 35.726.741/0001-39), GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA (38.280.883/0001-03), OCCAM FIC FIA (11.628.883/0001-03) e ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA (CNPJ: 38.027.169/0001-08).</p>	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2021
FPREV ALE:	a) Novos Recursos: aplicar no fundo BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC DE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO (CNPJ: 14.171.644/0001-57)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2021
FPREV MPE/PGJ:	Novos Recursos: aplicar no fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2021
FPREV - DPE/AM	Novos Recursos: aplicar no fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2021
FPREV - TJ/AM	Novos Recursos: aplicar no fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2021
FPREV - TCE/AM	Novos Recursos: aplicar no fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2021
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	15/03/2021
RECURSOS COMPREV	Aplicar os recursos no fundo Bradesco Maxi Poder Público.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2021
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	15/03/2021

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: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/02/2022 09:15:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/02/2022 09:23:37
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/02/2022 09:32:44

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/02/2022 15:07:36
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/02/2022 15:16:58
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2022 07:56:24
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/02/2022 08:19:39
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/02/2022 08:28:21

Documento assinado eletronicamente 118060/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEAMDYw



RELATÓRIOS - 2021



RELATÓRIO DE RISCOS FPREV - AMAZONPREV

Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/02/2022 09:15:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/02/2022 09:23:37
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/02/2022 09:32:44

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/02/2022 15:07:36
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/02/2022 15:16:58
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2022 07:56:24
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/02/2022 08:19:39
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/02/2022 08:28:21

Documento assinado eletronicamente 118060/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEAMDYw



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

TOTAL RENDA FIXA	R\$ 3.508.251.849,67
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.763.624.498,53
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 574.027.556,96
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 5.845.903.905,16

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso I, "a"	SALDO ATUAL	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	COTA DO FECHAMENTO MÊS	COTA 12M	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	jan22	2022
								RETORNO	RETORNO	RETORNO
TÍTULOS PÚBLICOS DO TESOURO	R\$ 761.030.352,30									
TOTAL - art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 761.030.352,30									

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso I, "b"	SALDO ATUAL	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	COTA DO FECHAMENTO MÊS	COTA 12M	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	jan22	2022
								RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Prev RF Tit Publ VII FI	R\$ 7.160.519,06	R\$ 249.437.254,95	1,97102589	1,85	1,67%	0,17%	-0,95	6,86%	0,56%	0,56%
Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	R\$ 53.521.131,17	R\$ 218.418.703,69	1,54728300	1,58	5,10%	0,52%	0,00	-2,05%	-0,03%	-0,03%
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	R\$ 462.797.410,61	R\$ 12.040.160.059,77	3,37112700	3,24	2,76%	0,29%	-2,29	4,32%	0,09%	0,09%
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	R\$ 603.998.071,27	R\$ 11.686.800.915,89	1,52281600	1,52	2,29%	0,24%	-1,00	0,53%	0,67%	0,67%
Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	R\$ 93.483.130,48	R\$ 725.628.592,32	3,73961050	3,60	2,80%	0,29%	-2,29	4,17%	0,09%	0,09%
Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	R\$ 110.618.395,53	R\$ 450.437.859,36	4,22094630	4,56	8,98%	0,93%	0,00	-6,88%	-1,64%	-1,64%
Safta Ima Institucional Fc FI RF	R\$ 137.556.316,21	R\$ 1.042.885.485,86	130,25090100	136,88	6,36%	0,66%	0,00	-4,22%	-1,00%	-1,00%
BB Prev RF Idka 2 FI	R\$ 508.203.212,16	R\$ 9.258.989.052,66	3,02589156	2,91	2,62%	0,27%	-2,26	4,47%	0,01%	0,01%
TOTAL - art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 1.977.338.186,49									

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso IV, "a"	SALDO ATUAL	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	COTA DO FECHAMENTO MÊS	COTA 12M	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	jan22	2022
								RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Prev RF Alocao Ativa Fcfl	R\$ 422.925.660,02	R\$ 7.461.201.984,89	1,52234308	1,52	2,77%	0,29%	-2,06	0,19%	0,04%	0,04%
Bradesco Fc FI RF Alocao Dinamica	R\$ 49.299.402,62	R\$ 1.144.155.045,62	1,28980810	1,28	2,58%	0,27%	-2,46	0,67%	0,24%	0,24%
Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	R\$ 58.598.045,76	R\$ 1.306.762.954,01	2,12829120	2,06	2,89%	0,30%	-2,32	3,76%	0,08%	0,08%
Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	R\$ 68.829,29	R\$ 772.524.998,23	3,60879970	3,44	0,15%	0,02%	0,00	4,84%	0,75%	0,75%
Itau Instit Alocao Dinamica RF FICFI	R\$ 113.710,44	R\$ 2.545.578.020,48	18,94101400	18,06	1,12%	0,12%	-1,05	4,93%	0,52%	0,52%
Bradesco FI RF Ref DI Premium	R\$ 21.703.737,83	R\$ 3.821.913.743,91	12,99245340	12,32	0,16%	0,02%	0,00	5,59%	0,78%	0,78%
TOTAL - art. 7º, inciso IV, "a"	R\$ 552.709.385,96									

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso VII, "b"	SALDO ATUAL	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	COTA DO FECHAMENTO MÊS	COTA 12M	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	jan22	2022
								RETORNO	RETORNO	RETORNO
Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	R\$ 31.148.580,12	R\$ 1.119.767.287,38	2,34796840	2,26	3,95%	0,41%	-3,99	4,34%	-0,15%	-0,15%
Mongeral Aegon Cred Priv FI RF LP	R\$ 34.307.092,32	R\$ 823.987.759,13	1,78329470	1,67	0,28%	0,03%	-0,05	6,85%	0,78%	0,78%
Sant RF Cred Priv Crescimento Inst FI LP	R\$ 54.279.703,58	R\$ 1.884.359.829,45	26,03474630	24,43	0,35%	0,04%	-0,04	6,68%	0,81%	0,81%
BTG Pact Cre Cor I FICFI RF Cred Priv	R\$ 35.332.039,01	R\$ 1.536.182.919,25	2,44896440	2,26	0,50%	0,05%	-0,10	8,51%	0,89%	0,89%
Itau High Grade RF Cred Priv FICFI	R\$ 62.106.509,89	R\$ 943.064.421,19	31,47141200	29,75	0,26%	0,03%	-0,01	5,89%	0,78%	0,78%
TOTAL - art. 7º, inciso VII, "b"	R\$ 217.173.924,92									

Quadro 1.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

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.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

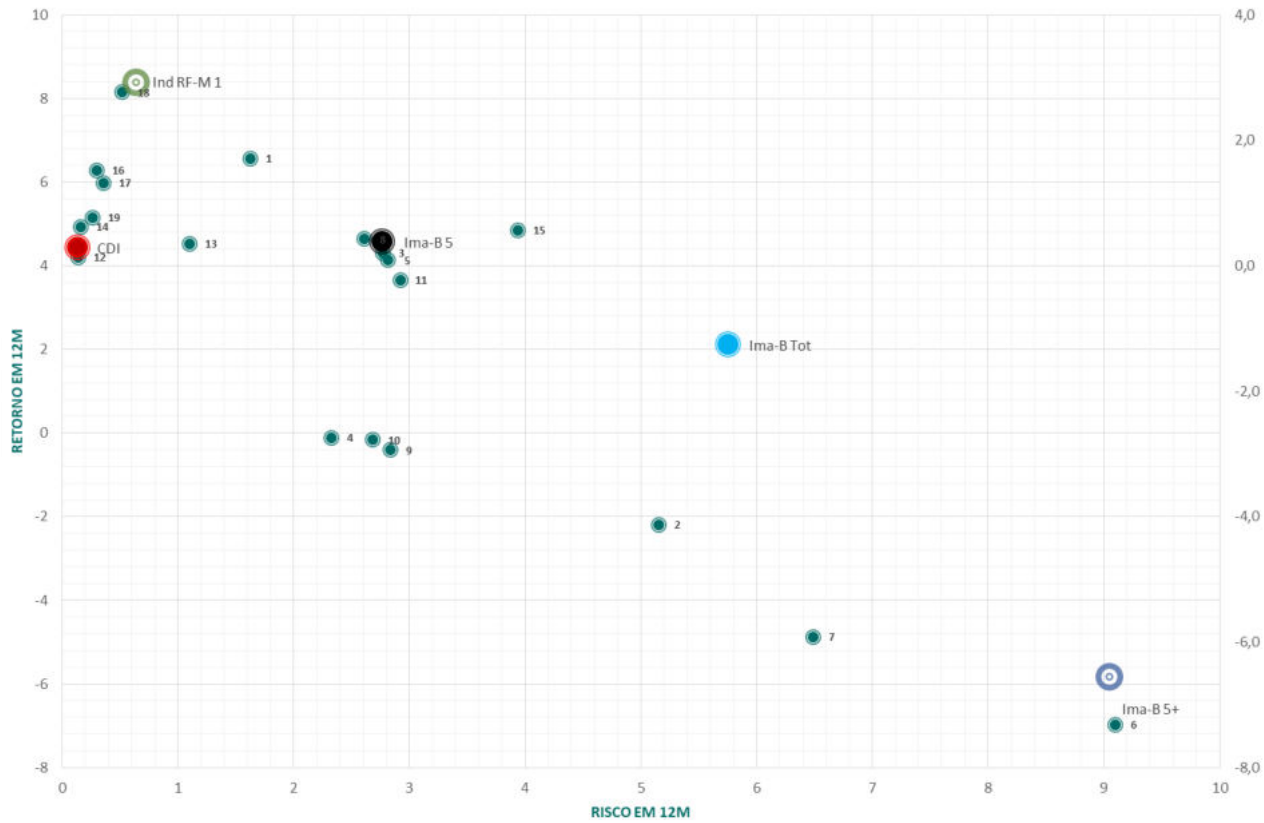


Gráfico 1: Art. 7º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

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 Alocacao Ativa Fc fi	-0,40	2,83	D+003	D+003
10	art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco Fc FI RF Alocacao 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 Alocacao 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.



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

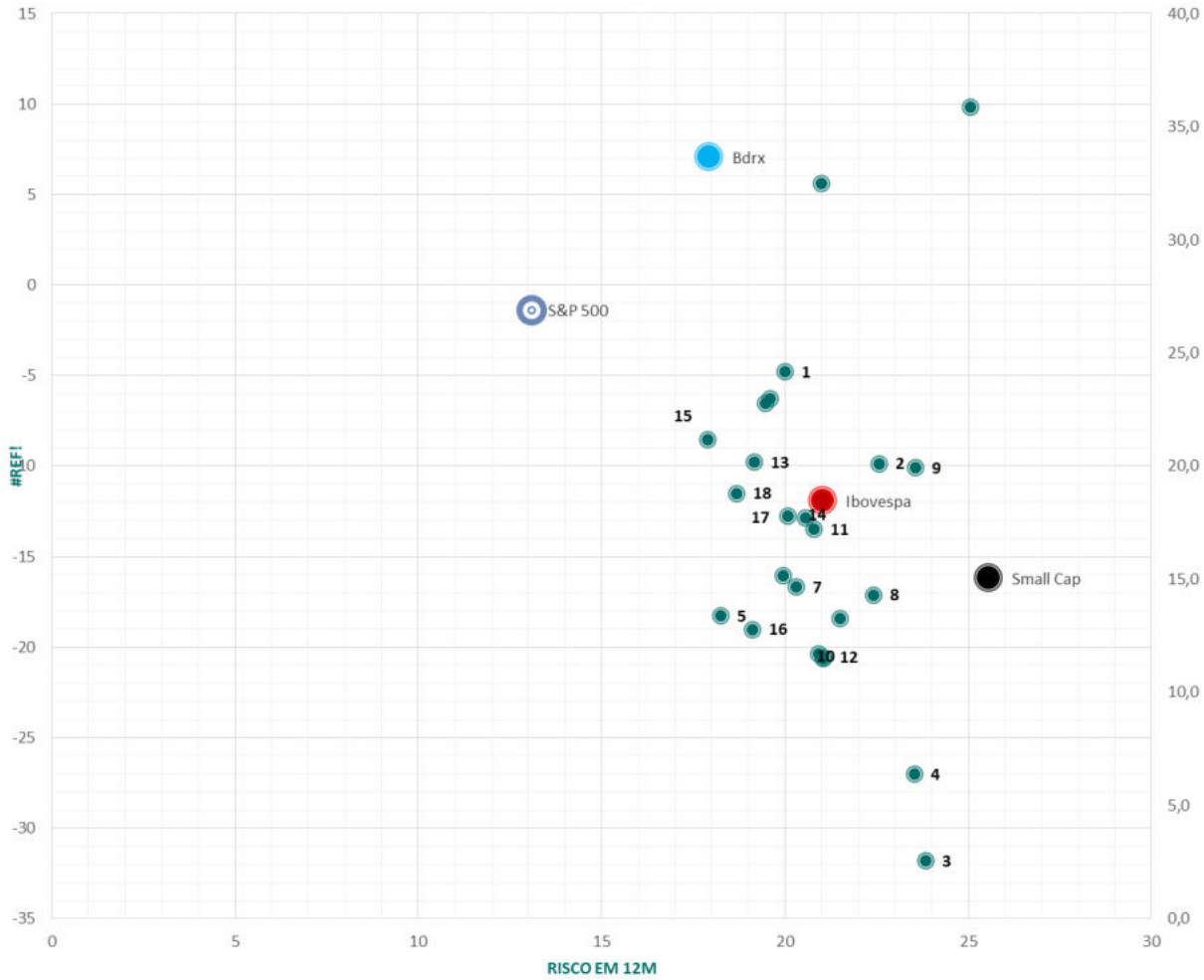


Gráfico 2: Art. 8º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

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 Instt 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.

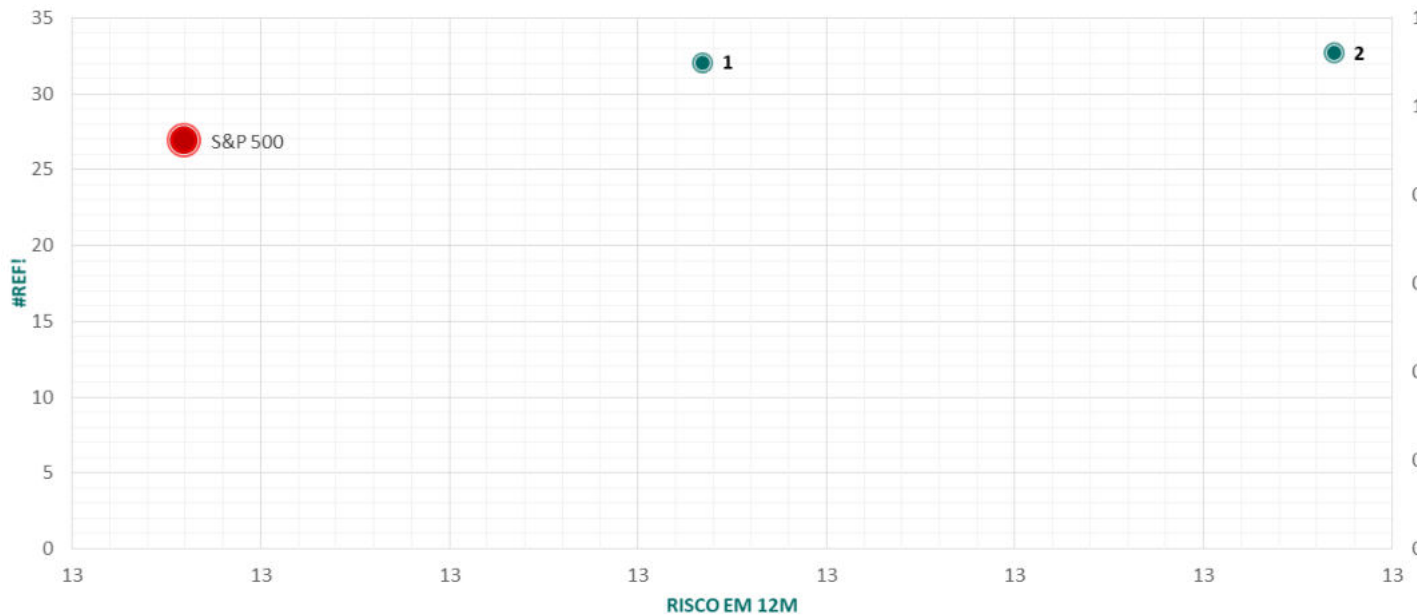


Gráfico 3: Art. 8-III,º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

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: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/02/2022 09:15:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/02/2022 09:23:37
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/02/2022 09:32:44

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/02/2022 15:07:36
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/02/2022 15:16:58
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2022 07:56:24
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/02/2022 08:19:39
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/02/2022 08:28:21

Documento assinado eletronicamente 118060/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEAMDYw



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

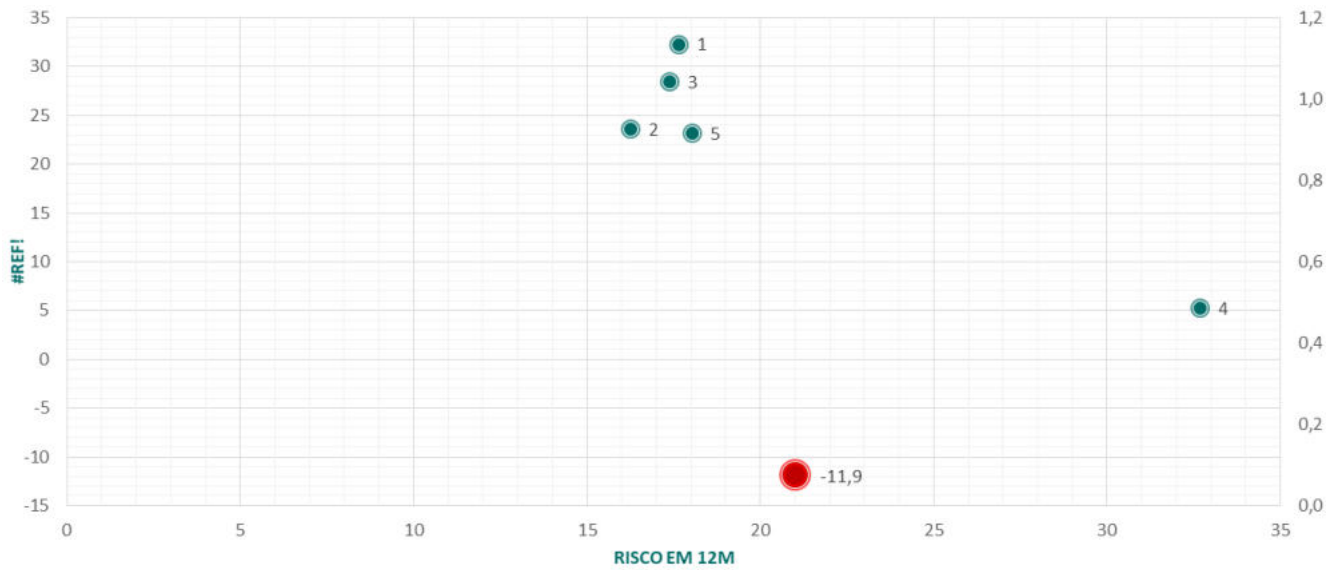


Gráfico 4: Art. 9º-A-II Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

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.

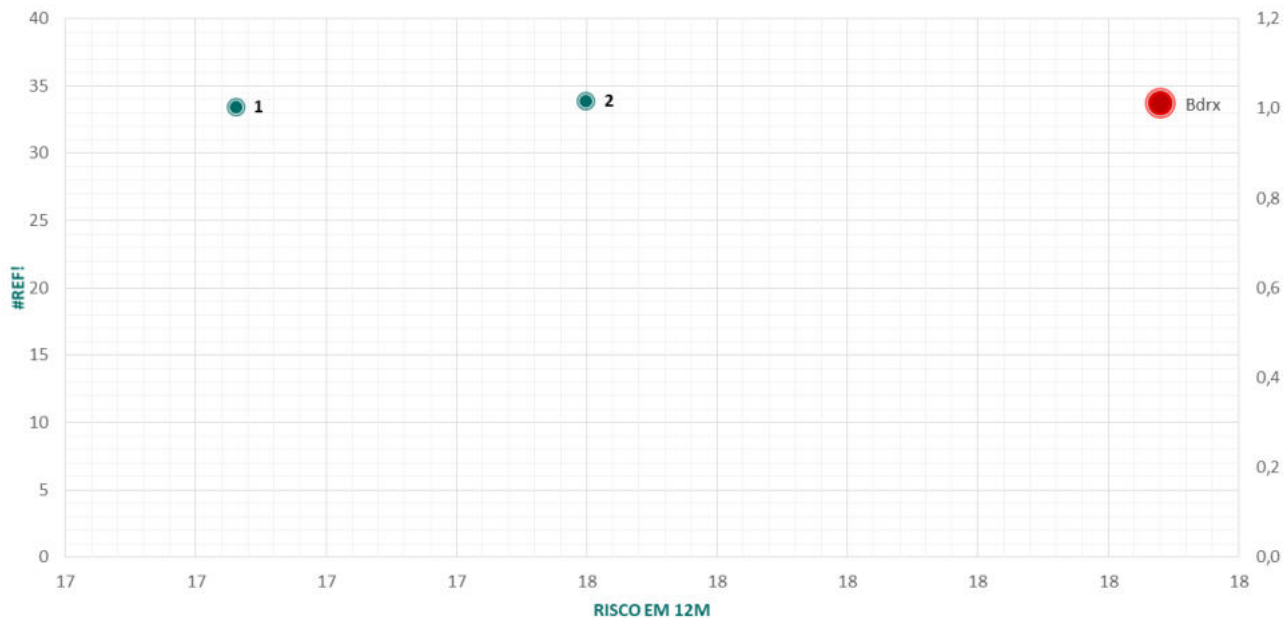


Gráfico 5: Art. 9-A-IIIº Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/02/2022 09:15:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/02/2022 09:23:37
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/02/2022 09:32:44

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/02/2022 15:07:36
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/02/2022 15:16:58
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2022 07:56:24
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/02/2022 08:19:39
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/02/2022 08:28:21

Documento assinado eletronicamente 118060/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEAMDYw



Relatório de Investimentos – Janeiro/2022

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: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/02/2022 09:15:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/02/2022 09:23:37
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/02/2022 09:32:44

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/02/2022 15:07:36
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/02/2022 15:16:58
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2022 07:56:24
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/02/2022 08:19:39
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/02/2022 08:28:21

Documento assinado eletronicamente 118060/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTEAMDYw



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 janeiro/2022, 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 fevereiro de 2022.

Alan Nascimento
Coordenador

Bruno Costa Novo
Secretário

Bruno Barroso
Membro

Leonardo Cavalcanti
Membro

Wellington Guimaraes
Membro

Claudinei Soares
Membro

André Luiz Bentes
Membro

Marcos Souza
Membro

Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/02/2022 09:15:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/02/2022 09:23:37
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/02/2022 09:32:44

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/02/2022 15:07:36
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/02/2022 15:16:58
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2022 07:56:24
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/02/2022 08:19:39
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/02/2022 08:28:21

Documento assinado eletronicamente 118060/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTEAMDYw

