



GOVERNO DO ESTADO DO AMAZONAS



AMAZONPREV

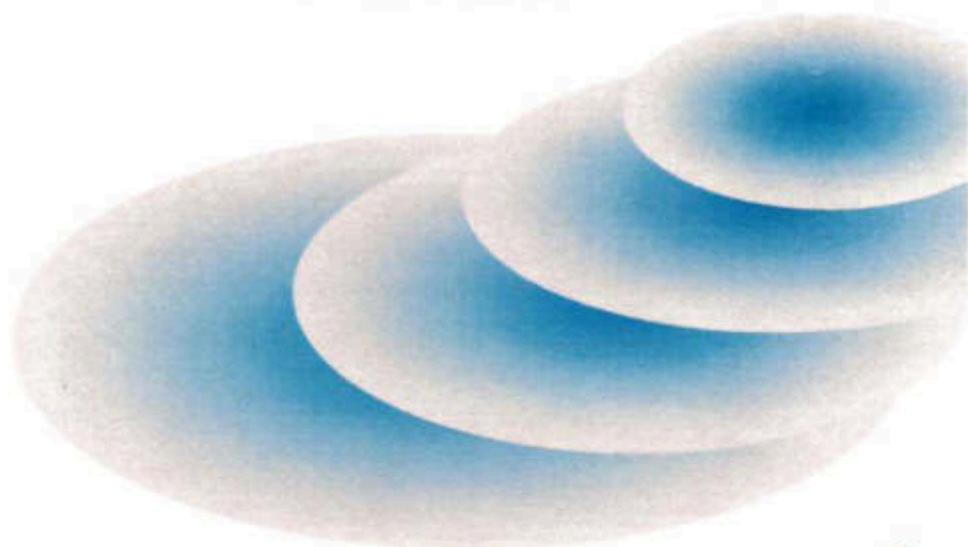
Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



RELATÓRIOS - 2020

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Julho / 2020



Destino: DIRAF / PRESI

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

Data: 14/08/2020

RELATÓRIO Nº. 029/2020 – COMIV

Senhores Diretores,

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

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 03 a 06);
- 2) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Poder Executivo, apresentando os saldos e **performance** dos Fundos de Investimentos, evolução dos saldos dos Fundos de Investimentos, imóveis e CVS, comparativo da rentabilidade com a Meta Atuarial, Evolução e variação dos recursos do FPREV Executivo (páginas 07 a 13)
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 14 a 15)
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (página 16)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (página 17)
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (página 18)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (páginas 19)
- 8) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado – FPREV (página 20)
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro: Executivo, DPE, ALE e MPE – (páginas 21)
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 22)
- 11) Outros Recursos do Tribunal de Justiça – TJ/AM e Tribunal de Contas do Estado - TCE: Saldos (página 23)
- 12) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 24 a 28)
- 13) Total dos Recursos e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 29)
- 14) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 30)
- 15) Relatório de Riscos da Carteira (página 31 a 36)
- 16) Parecer do Comitê de Investimentos (página 37).



1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

Com apoio dos Relatórios: Carta do Gestor – Agosto/2020, emitido pela BRAM Asset Management:

Indicadores de atividade apontam início da retomada econômica em maio, ainda de forma gradual.

O Índice do Banco Central de atividade (IBC Br) avançou 1,3% em maio. O indicador prévio do PIB refletiu as altas da indústria (7%) e do comércio (19,6%) e o recuo do setor de serviços (0,9%) no mês. Na comparação interanual, o índice mantém queda expressiva, de 14,2%. A média dos dados de dados de abril e maio representa recuo de 12,6% em relação à média do 1º trimestre. Nas próximas leituras, com a gradual flexibilização de medidas de isolamento social, os dados devem revelar a continuidade dessa recuperação da atividade.

Dados do mercado de trabalho de junho surpreenderam positivamente, com destruição de vagas formais abaixo do esperado. Considerado os dados com ajuste sazonal, o saldo negativo de criação de vagas (CAGED) foi de 8,7 mil no mês, ante destruição de 389 mil vagas em maio e 958 mil vagas em abril. Até junho, 1,4 milhão de postos formais de trabalho foram destruídos. O resultado do mês reforça a retomada gradual da atividade, em meio ao relaxamento das medidas de isolamento social. Por outro lado, o número de admissões, que indica retomada do mercado de trabalho, ainda segue baixo. Além disso, os dados da Pnad Covid que incorporam o mercado de trabalho informal, apontam um aumento da taxa de desemprego ajustada (que considera aqueles que deixaram de buscar emprego em função da crise) de 22% em maio para 23% em junho. A partir do conjunto de dados de atividade e mercado de trabalho, o tracking do PIB do 2º trimestre se situa ao redor de -9% na margem.

A inflação ao consumidor (IPCA) apresentou alta em junho e na prévia de julho (IPCA 15) após dois meses de deflação. O IPCA variou 0,26% em junho e o IPCA 15 variou 0,30% em julho. A prévia de julho surpreendeu as projeções em cerca de 0,2% p.p, com surpresa baixista disseminada entre os grupos, principalmente 'Alimentação e Bebidas'. A média dos núcleos de inflação (exclui itens voláteis) segue baixa em ambos indicadores, atingindo 0,11% no IPCA 15, ao passo que, em doze meses, a média se manteve próxima do patamar dos 2%, o que sinaliza continuidade do cenário benigno para a inflação. A retomada da demanda de forma mais robusta e a pressão dos preços no atacado podem trazer alguma pressão adicional, porém os repasses devem continuar limitados.

No cenário global, afetado pela pandemia, o PIB dos EUA contraiu 32,9% no 2º trimestre, a maior retração da história do país.

Entre os componentes do PIB, a maior contribuição negativa foi de gastos com consumo (-34,6%) principalmente consumo de serviços (-43,5%). Os dados são compatíveis com a restrição de atividades para



contenção da pandemia adotadas durante o semestre. Apesar da queda no 2º trimestre, os dados de atividade de junho já apontam para retomada na ponta, com varejo avançando 7,5% e produção industrial 5,4%, ambos na margem. Por outro lado, dados de mercado de trabalho mantém a incerteza elevada, com dados de novos pedidos de seguro desemprego crescendo consecutivamente nas duas últimas semanas de julho, o que não ocorria desde o início da crise. Apesar do cenário incerto, os indicadores de atividade apontam retomada da atividade no próximo trimestre. No ano, o PIB deve recuar em torno de 5%.

O mês de julho foi novamente positivo. Apesar do risco de uma segunda onda de contaminação, o anúncio da finalização dos testes para uma vacina contra o Covid 19 aumenta a confiança. Entretanto, dados de emprego dos Estados Unidos, apesar da melhora, permanecem significativamente abaixo do nível do início do ano. Além disso, questões relacionadas a guerra comercial entre EUA e China estão ressurgindo, com ataque direto a empresas. E por fim, todo esse cenário se desenha às vésperas das eleições americanas e o receio com relação ao um ressurgimento da doença pelo mundo.

Apesar de aqui no Brasil a primeira onda não ter terminado, os ativos de risco permanecem em ascensão. Os dados de atividade e confiança, assim como no resto do mundo, mantiveram o otimismo com relação a uma recuperação mais rápida e reforçam o sentimento de que o pior ficou para trás. Por outro lado, o risco fiscal continua em voga, devido às sinalizações e tentativas do governo de retirar do teto de gastos para poder investir mais.

Julho foi um mês muito bom para os ativos aqui no Brasil, tanto para o prefixado quanto para os ativos atrelados à inflação. O que mais chama a atenção foi o desempenho dos ativos de longo prazo, principalmente os indexados à inflação, pelo vencimento mais distante e por terem ficado fora do radar dos investidores, por causa do risco. No câmbio, a volatilidade permanece, o dólar fechou a R\$ 5,2033 com queda de 4,980%.

Julho, também, foi o quarto mês consecutivo de recuperação expressiva da bolsa brasileira, reafirmando o período como o melhor desde o segundo semestre de 2003 (no caso do S&P 500 desde 2009).

O rápido avanço dos testes de vacinas para o Covid 19 dados de atividade melhores do que o esperado, demonstrando o sucesso das medidas de estímulo às economias implementadas pelos governos, assim como a expectativa de novas medidas de ajuda pelos governos permanecem sustentando a boa performance das bolsas pelo mundo. De qualquer forma, fica a sensação de maior peso para as notícias positivas de curto prazo, em detrimento das preocupações de médio prazo, quando os pacotes de ajuda forem atenuados. Com isso, o S&P 500 teve retorno de 5,5% alcançando ganho no ano de +1,3% (chegou a ser de -34% no ano). O índice Nasdaq, dominado pelos setores de tecnologia e varejo ligado a e commerce (grandes destaques de performance), teve retorno de 6,8% acumulando o impressionante retorno de 19,8% no ano.

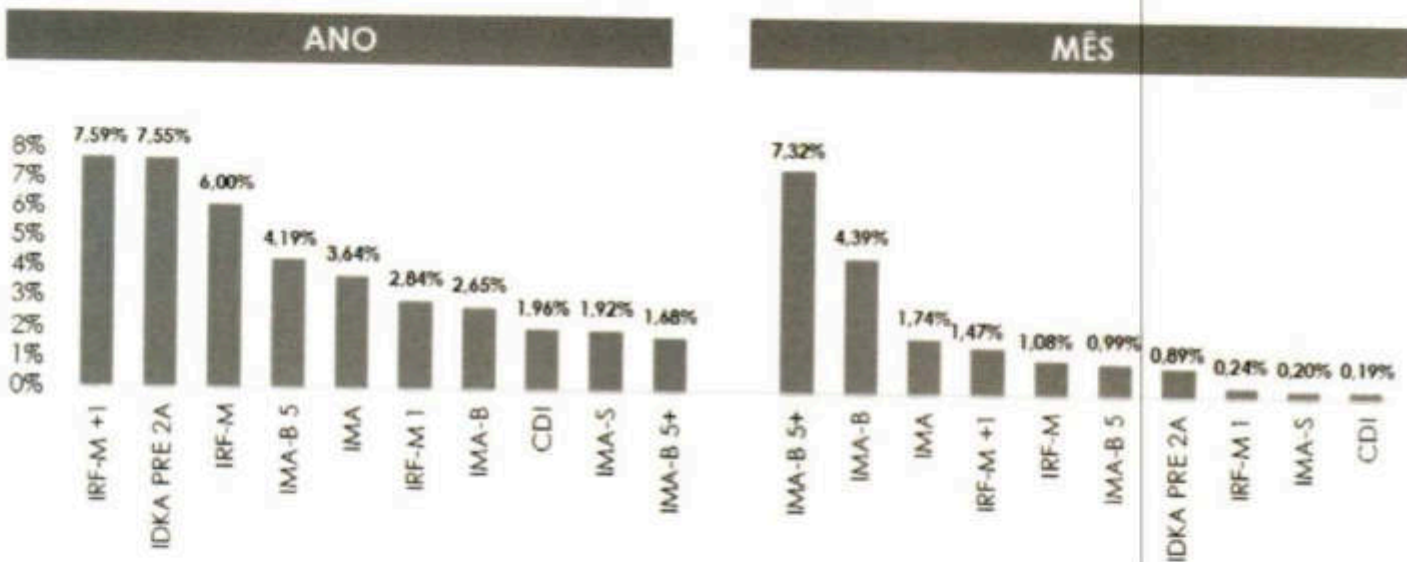


Relatório de Investimentos – Julho/2020

No Brasil, o Ibovespa teve retorno de 8,3% reduzindo a queda no ano para -11%. Além da influência das bolsas no exterior, a combinação de diversos fatores locais ajuda a explicar a performance positiva, como a expectativa de retomada da agenda de reformas do governo, uma onda de revisões menos negativas para o PIB no ano, juros em patamares historicamente baixos e o fluxo do investidor local para a bolsa, mesmo com o fluxo do investidor estrangeiro voltando a ser negativo. A gestão acredita que a assimetria parece menos favorável à bolsa brasileira, principalmente pela deterioração do quadro fiscal, pelo risco de uma nova onda de Covid 19 e porque os fatores positivos mencionados já estão incorporados nos preços. Ainda, estamos na temporada de resultados do 2º trimestre, o mais impactado pela quarentena, e algumas empresas podem decepcionar. Por outro lado, os gestores continuam com visão positiva para renda variável no médio e longo prazos, uma vez que o mercado tem voltado sua atenção para 2021 reduzindo o peso do curto prazo em suas expectativas.

Setores considerados como cíclicos domésticos foram destaque em julho na esteira das revisões menos negativas para o PIB de 2020 como Bens de Capital, Educação, Consumo e Construção Civil. Por outro lado, os setores vistos como defensivos domésticos foram destaque negativo, como Bebidas, Shoppings Properties e Saúde.

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA FIXA



Handwritten signatures in blue ink, including a large signature and several smaller ones, located in the bottom right corner of the page.

Relatório de Investimentos – Julho/2020

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA VARIÁVEL

	JULHO	2020	12 MESES	24 MESES	36 MESES
IBOVESPA	8,27%	-11,01%	1,08%	29,91%	56,12%
SMLL	9,50%	-13,20%	7,86%	55,28%	71,97%
IBRX	8,41%	-10,43%	2,17%	33,69%	59,04%
IDIV	6,53%	-13,05%	3,50%	46,49%	63,19%
S&P 500 (USD)	5,51%	1,25%	9,76%	16,15%	32,42%
MSCI World (USD)	4,69%	-2,27%	5,37%	7,05%	17,54%

Em linha com o mercado financeiro, os fundos que a Amazonprev possui aplicações, também registraram bons desempenhos no mês de julho/2020. Esses resultados já eram esperados, pois as análises dos especialistas, ainda em fevereiro/2020, já indicavam possibilidade de recuperação da economia, mesmo que em menor ritmo, no segundo trimestre de 2020. Fato sinalizado em março/2020 pelo Comitê.

Apesar do resultado ser positivo nos últimos meses, o acumulado anual ainda está negativo nesse exercício, no entanto, vê-se com otimismo a chegada do 2º semestre de 2020, momento em que se deve observar os resultados das medidas tomadas pela Amazonprev, no sentido de recuperar o desempenho anterior, com maior exposição em fundos de maior volatilidade.



Relatório de Investimentos – Julho/2020

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/06/2020	31/07/2020	mai/20	jun/20	jul/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 664.032.802,18	R\$ 675.771.367,31	1,0721	0,9486	1,7677	3,8345%	3,5486%	NC	
BB PREVID TP VII	R\$ 19.627.720,37	R\$ 19.690.546,75	1,2480	0,9923	0,3200	2,5799%	1,9670%	5,7422%	
BB PREVID RF IMA B5+	R\$ 169.213.817,57	R\$ 181.529.262,91	0,9976	2,8000	7,2780	11,3820%	1,5116%	NC	
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 62.103.015,16	R\$ 63.164.341,90	1,1200	0,9500	1,7100	3,8262%	3,5130%	NC	
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ -	R\$ -	2,1600	-	-	2,1600%	2,1162%	6,5580%	
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 22.911.270,48	R\$ 4.164.314,05	0,2200	0,1928	0,1702	0,5841%	1,7710%	3,9099%	
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF	R\$ 44.004.612,85	R\$ 44.035.009,99	0,8000	0,8900	0,0700	1,7683%	0,8035%	4,1805%	
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 53.476.613,33	R\$ 54.420.931,13	3,1500	1,2400	1,7700	6,2775%	5,6992%	11,1781%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 637.005.244,43	R\$ 535.189.051,03	2,1053	1,0986	0,9736	4,2320%	4,0456%	8,5375%	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 518.523.081,43	R\$ 523.590.614,37	1,3787	0,7496	0,9773	3,1368%	5,6478%	9,6795%	
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 26.170.361,89	R\$ 26.675.527,13	2,1900	1,4600	1,9300	5,6830%	3,2102%	6,8731%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 55.756.061,71	R\$ 56.325.035,64	2,1500	1,0800	1,0200	4,3064%	4,1054%	8,6285%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 105.056.865,56	R\$ 112.773.605,36	0,9900	2,7800	7,3500	11,4266%	1,4398%	7,4947%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 239.331.279,83	R\$ 240.651.175,07	0,5400	0,4358	0,5500	1,5336%	2,8271%	5,1958%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 104.586.284,67	R\$ 109.613.886,14	1,6000	2,1100	4,8100	8,7338%	4,2787%	NC	
SANTANDER RF ATIVO FIC	R\$ -	R\$ -	0,4833	-	-	0,4833%	1,6378%	2,0477%	
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 2.721.799.031,46	R\$ 2.647.594.668,78							
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	29/05/2020	31/07/2020	mai/20	jun/20	jul/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 81.204.510,71	R\$ 86.382.918,14	7,4818	7,4382	6,3769	22,8403%	-19,5898%	NC	
BB FIA BDR NIVEL I	R\$ 15.361.287,52	R\$ 15.534.771,99	-	3,1871	1,1293	4,3524%	4,3524%	NC	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 110.395.608,78	R\$ 119.480.939,78	6,1800	8,5000	8,2300	24,6867%	-8,6342%	NC	
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPH	R\$ 27.761.113,90	R\$ 30.102.602,94	8,4600	8,7400	8,4300	27,8817%	-9,2523%	NC	
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 210.094.782,32	R\$ 238.803.808,82	10,2769	15,9666	8,3800	38,6011%	4,4877%	18,5816%	
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 84.934.055,50	R\$ 91.229.733,10	7,5516	9,8030	7,4124	26,8485%	-4,7338%	15,9418%	
ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FI	R\$ 22.105.024,10	R\$ 24.040.384,89	9,1800	9,2500	8,7600	29,7280%	-9,9461%	NC	
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 216.257.289,41	R\$ 225.689.676,46	5,8200	7,8900	4,3600	19,1470%	-16,5707%	-4,4114%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 140.814.052,69	R\$ 151.427.864,43	5,3600	11,8849	7,5400	26,7702%	-14,2546%	1,6071%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 8.707.103,29	R\$ 9.443.993,83	7,9400	8,6184	8,4600	27,1614%	-9,5567%	4,3531%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 115.890.122,03	R\$ 122.608.987,81	9,1800	12,0980	5,8000	29,4871%	-24,3602%	-12,4172%	
ITAU SMALL CAPS VALUATION	R\$ 44.211.164,42	R\$ 47.975.710,37	4,5600	11,4837	8,5100	26,4872%	-20,0481%	NC	
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 59.615.724,98	R\$ 64.928.538,64	6,0160	9,3061	8,9118	26,2091%	-15,9272%	-3,2501%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 86.137.750,77	R\$ 93.592.391,69	7,9378	7,7048	8,6543	26,3152%	-14,7996%	NC	
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$ 40.121.483,05	R\$ 43.696.543,55	6,0161	9,3085	8,9106	26,2106%	-17,5147%	NC	
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 15.000.000,00	R\$ 15.419.002,92	-	-	2,7934	2,7934%	2,7934%	NC	
SAFRA S&P REAIS	R\$ 18.110.189,39	R\$ 19.121.367,75	5,1838	0,9100	5,5800	12,0636%	-0,6345%	8,8227%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 35.885.569,14	R\$ 36.611.365,91	0,9593	0,9200	2,0200	3,9463%	3,9463%	NC	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 26.533.867,70	R\$ 41.344.206,31	-	8,5400	13,8500	23,5728%	23,5728%	NC	
OCCAM FIC FIA	R\$ 26.750.741,64	R\$ 40.362.999,80	-	8,9700	9,9000	19,7580%	19,7580%	NC	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 16.191.026,57	R\$ 17.924.881,45	-	7,9401	10,7087	19,4991%	19,4991%	NC	
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.402.082.467,91	R\$ 1.535.722.690,58							

Quadro 1.

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

Nota 2: Com base na Ata COMIV 164/2020, a Diretoria Deferiu as sugestões para ratear os novos recursos nos fundos: OCCAM FIC FIA, AZ Quest Small FIC FIA e BTG Absoluto Institucional FIQ FIA. Para os recursos já em

7

Relatório de Investimentos – Julho/2020

carteira, foi aprovado migrar o valor de R\$ 15 milhões do fundo BB Previdenciário Alocação ativa para o fundo BB FI Ações BDR Nível I. Da mesma forma, foi aprovado migrar R\$ 15 milhões do fundo Safra IMA Institucional para o fundo Safra Consumo Americano BDR Nível I. Também aprovada a migração do valor de R\$ 15 milhões do fundo BB Previdenciário Alocação Ativa para o fundo Santander FI Global Equities Multimercado Investimento no Exterior;

Nota 3: Conforme Parecer nº. 1133/2020-COMIV, registra-se que para o desinvestimento das aplicações, visando cumprir os termos da LC 206/2020 – FTEMP, serão utilizados os recursos aplicados no fundo Caixa FI Brasil IMA B5;

2.2 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXECUTIVO

INSTITUIÇÃO	mai/20	jun/20	jul/20
BRADERCO	R\$ 265.695.140,35	R\$ 223.171.008,32	R\$ 216.912.198,67
BANCO DO BRASIL	R\$ 947.235.106,58	R\$ 949.440.138,35	R\$ 978.908.867,10
CAIXA	R\$ 1.318.540.055,77	R\$ 1.337.943.607,54	R\$ 1.248.465.339,62
ITAÚ	R\$ 515.204.940,53	R\$ 548.953.722,26	R\$ 572.107.731,51
SANTANDER	R\$ 264.926.025,40	R\$ 200.874.958,80	R\$ 217.636.476,80
ICATU/BEM DTVM	R\$ 403.839.772,12	R\$ 425.345.602,67	R\$ 445.504.229,48
SAFRA	R\$ 155.386.015,29	R\$ 158.582.043,20	R\$ 165.346.619,80
BTG PACTUAL	R\$ 181.168.220,48	R\$ 210.094.782,32	R\$ 238.803.808,82
AZ QUEST	R\$ 15.000.000,00	R\$ 26.533.867,70	R\$ 41.344.206,31
OCCAM BRASIL	R\$ 15.000.000,00	R\$ 26.750.741,64	R\$ 40.362.999,80
SULAMÉRICA	R\$ 15.000.000,00	R\$ 16.191.026,57	R\$ 17.924.881,45
TOTAL	R\$ 4.096.995.276,52	R\$ 4.123.881.499,37	R\$ 4.183.317.359,36

Quadro 2.

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA FPREV EXEC - JULHO - 2020

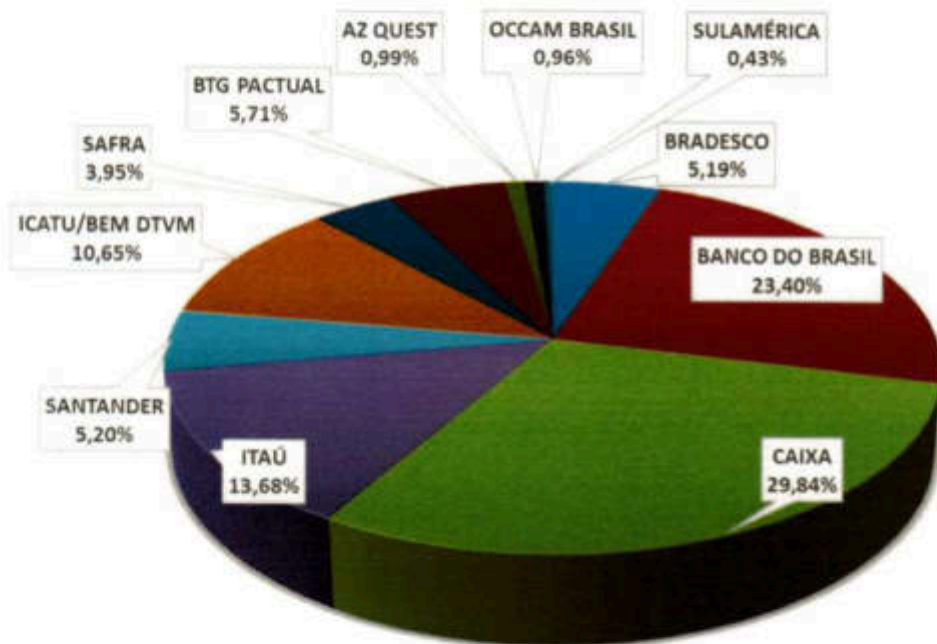


Gráfico 1

2.3 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA – FPREV EXECUTIVO

(Handwritten signatures and initials)

Relatório de Investimentos – Julho/2020

2.3 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA – FPREV EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	ÍNDICE DE REFERÊNCIA	SALDO APLICADO	% APLICADO
BRABESCO FI REFER DI PREMIUM BRABESCO FI MAXI PODER PUBLICO	CDI	R\$ 4.164.314,05	0,10%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA BB PREVID ALOCAÇÃO ATIVA SAFRA S&P REAIS BRABESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI SANTANDER RF ATIVO FIC	CDI ATIVO	R\$ 1.522.298.866,40	36,39%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF SANTANDER IMA B INST. TP	IMA B	R\$ 109.613.886,14	2,62%
BRABESCO INST. FIC FI RF IMA B5 CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP ICATU VANG. FI RF INFLA. CP ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	IMA B 5	R\$ 618.189.613,80	14,78%
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF BB PREVID RF IMA B5+	IMA B5+	R\$ 294.302.868,27	7,04%
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF BB PREVID TP VII	IPCA + 6%	R\$ 118.146.487,87	2,82%
BRABESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI	IBR X	R\$ 54.142.987,83	1,29%
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA BRABESCO FIA MID SMALL CAPS ITAÚ SMALL CAPS VALUATION CAIXA CONSUMO FI AÇÕES ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES BTG ABSOLUTO FIQ FIA SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES SANTANDER SELEÇÃO 30 AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA OCCAM FIC FIA SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	IBOVESPA	R\$ 1.394.893.194,18	33,34%
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR BB FIA BDR NIVEL I SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	BDR NIVEL I	R\$ 67.565.140,82	1,62%
TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO		R\$ 4.183.317.359,36	100%

Quadro 3.

Relatório de Investimentos – Julho/2020

DISTRIBUIÇÃO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA - FPREV EXECUTIVO

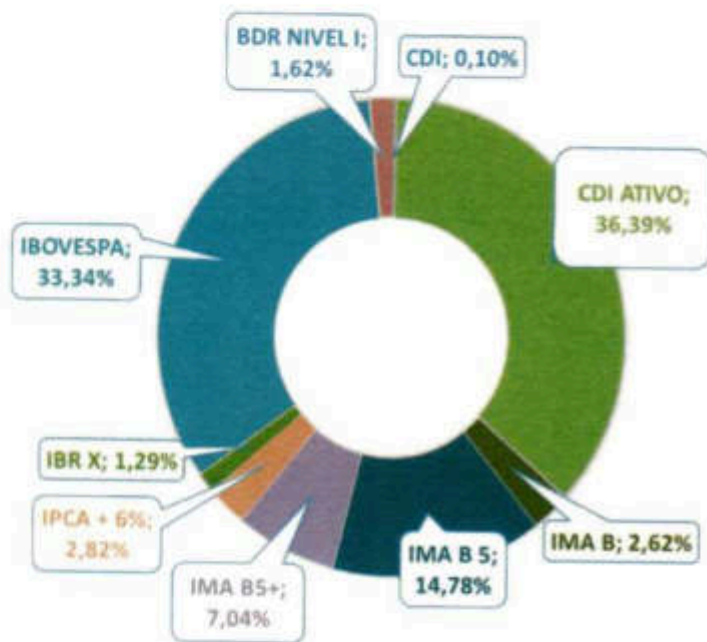


Gráfico 2.

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/06/2020	31/07/2020	mai/20	jun/20	jul/20	TRIMESTRE	2020	ULTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 153.276.610,48	R\$ 154.635.384,11	0,1426	0,7860	0,8865	1,824%	4,2059%	8,9348%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 159.561.911,64	R\$ 160.991.488,53	0,1520	0,7954	0,8959	1,853%	4,2742%	9,0574%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 163.149.187,70	R\$ 164.649.485,23	0,1755	0,8190	0,9196	1,925%	4,4454%	9,3645%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 165.368.827,86	R\$ 166.850.457,24	0,1520	0,7954	0,8959	1,853%	4,2743%	9,0576%
TOTAL GERAL	R\$ 641.356.537,68	R\$ 647.126.815,12						

Quadro 4.

Nota 1: Títulos Públicos atualizados pelo valor de aquisição acrescido da taxa de juros. (Ver quadro 5)

Relatório de Investimentos – Julho/2020

2.6 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

SEGMENTO	Renda Fixa		Renda Fixa	
TIPO DE ATIVO	NTN B		NTN B	
INTERMEDIÁRIO	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		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\$ 154.635.384,11	R\$ 160.991.488,53	R\$ 164.649.485,23	R\$ 166.850.457,24
DATA DE EMISSÃO	15/01/2014		10/02/2010	
DATA DA APLICAÇÃO	15/01/2014		29/01/2014	
DATA DO RESGATE	15/05/2023		15/08/2030	
TAXA DE JUROS CONTRATADA	6,48%		6,90%	

Quadro 5.

2.7 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	30/06/2020	31/07/2020
CVS - A	R\$ 1.362.172,70	R\$ 1.362.172,70
CVS - B	R\$ 8.813.869,30	R\$ 8.813.869,30
CVS - C	R\$ 176.703,80	R\$ 176.703,80
CVS - D	R\$ 966.558,12	R\$ 966.558,12
TOTAL	R\$ 11.319.303,92	R\$ 11.319.303,92

Quadro 6.

Nota 1: 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.

Nota 2: Devido a problemas de acesso ao sistema CETIP, para emissão dos Relatórios de atualização dos Títulos CVS, não foi possível atualizar a Posição desses ativos no mês de julho/2020.

2.8 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/20	R\$ 35.286,77	R\$ 145.084,72	R\$ 180.371,49
fev/20	R\$ 34.866,79	R\$ 145.084,72	R\$ 179.951,51
mar/20	R\$ 34.446,81	R\$ 145.084,72	R\$ 179.531,53
abr/20	R\$ 34.026,85	R\$ 145.084,72	R\$ 179.111,57
mai/20	R\$ 33.606,86	R\$ 145.084,72	R\$ 178.691,58
jun/20	R\$ 33.186,90	R\$ 145.084,72	R\$ 178.271,62
jul/20	R\$ 32.766,93	R\$ 145.084,72	R\$ 177.851,65
TOTAL	R\$ 238.187,91	R\$ 1.015.593,04	R\$ 1.253.780,95

Quadro 7.

Relatório de Investimentos – Julho/2020

2.9 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2020 (Contrato Regular)					
MÊS	UEA		SEAS		TOTAL
jan/20	R\$	-	R\$	-	R\$ -
fev/20	R\$	-	R\$	-	R\$ -
mar/20	R\$	58.180,96	R\$	301.093,20	R\$ 359.274,16
abr/20	R\$	58.180,96	R\$	-	R\$ 58.180,96
mai/20	R\$	-	R\$	301.093,20	R\$ 301.093,20
jun/20	R\$	145.452,40	R\$	-	R\$ 145.452,40
jul/20	R\$	43.635,72	R\$	100.364,00	R\$ 143.999,72
TOTAL	R\$	305.450,04	R\$	702.550,40	R\$ 1.008.000,44

Quadro 8.

2.10 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	30/06/2020	31/07/2020	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.123.881.499,37	R\$ 4.183.317.359,36	85,3370%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 641.356.537,68	R\$ 647.126.815,12	13,2010%
TÍTULOS CVS	R\$ 11.319.303,92	R\$ 11.319.303,92	0,2309%
IMÓVEIS	R\$ 60.353.005,55	R\$ 60.353.005,55	1,2312%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 564.721,05	R\$ 1,00	0,0000%
TOTAL	R\$ 4.837.475.067,57	R\$ 4.902.116.484,95	100,00%

Quadro 9.

2.11 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS – FPREV EXECUTIVO

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
jul/19	R\$ 4.650.607.110,06	1,98%	14,77%	25,75%
ago/19	R\$ 4.698.765.985,21	1,04%	15,96%	25,85%
set/19	R\$ 4.814.401.867,02	2,46%	18,81%	26,83%
out/19	R\$ 4.927.631.461,93	2,35%	21,60%	26,59%
nov/19	R\$ 4.968.291.263,50	0,83%	22,61%	26,14%
dez/19	R\$ 5.173.977.182,42	4,14%	27,68%	27,68%
jan/20	R\$ 5.215.753.953,85	0,81%	0,81%	25,83%
fev/20	R\$ 5.147.828.344,11	-1,30%	-0,51%	22,61%
mar/20	R\$ 4.677.866.125,22	-9,13%	-9,59%	9,54%
abr/20	R\$ 4.755.324.126,81	1,66%	-8,09%	7,07%
mai/20	R\$ 4.808.084.982,84	1,11%	-7,07%	5,43%
jun/20	R\$ 4.837.475.067,57	0,61%	-6,50%	4,02%
jul/20	R\$ 4.902.116.484,95	1,34%	-5,25%	4,33%

Quadro 10.

Relatório de Investimentos – Julho/2020

2.12 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - EXECUTIVO2020

10/08/2020 14:39:44

Fundo Previdenciário

Cálculo Posicionado em 31/07/2020

Mês/Ano	Saldo Financeiro em 31/07/2019		4.650.607.110,06
	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
08/2019	39.885.991,44	1.920.723,93	37.965.267,51
09/2019	41.301.229,85	1.811.278,88	39.489.950,97
10/2019	40.858.104,23	2.023.186,58	38.834.917,65
11/2019	40.805.162,75	889.103,33	39.916.059,42
12/2019	80.878.067,28	1.824.810,55	79.053.256,73
01/2020	31.251.496,04	2.054.191,64	29.197.304,40
02/2020	49.583.021,72	4.910.443,54	44.672.578,18
03/2020	44.294.358,68	12.998.534,20	31.295.824,48
04/2020	41.873.777,81	12.578.581,62	29.295.196,19
05/2020	40.614.112,23	22.981.825,96	17.632.286,27
06/2020	32.820.094,52	4.132.267,04	28.687.827,48
07/2020	33.058.400,54	21.822.876,11	11.235.524,43
	Saldo Financeiro em 31/07/2020		4.902.117.066,26

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual:	5,8800 %	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	2,3055 %	0,4583 %	0,3600 %
Juros	5,8800 %	3,3891 %	0,4773 %
Meta	8,3210 %	3,8629 %	0,8390 %
Rentabilidade %	-3,6033 %	-8,7987 %	1,1040 %
Rentabilidade R\$	-175.766.037,51	-463.876.657,59	53.406.474,26
Resultado %	-11,0083 %	-12,1908 %	+0,2628 %
Resultado R\$	-581.274.402,66	-667.447.181,28	+12.820.618,40

Quadro 11.

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. Os valores são registrados sob Regime de Caixa.

Nota 2: O resultado do Executivo FPREV tem sido impactado diretamente pela transferência dos recursos referentes ao Fundo Temporário – FTEMP, não sendo registrados como Despesas.

ACOMPANHAMENTO DO SALDO DO FUNDO TEMPORÁRIO - FTEMP		
SALDO INICIAL FTEMP (*)		R\$ 1.088.777.939,69
REFERÊNCIA	TOTAL DAS FOLHAS	SALDO DISPONÍVEL DO FUNDO TEMPORÁRIO (FTEMP)
ABRIL	R\$ 86.297.366,11	R\$ 1.002.480.573,58
MAIO	R\$ 541.275,12	R\$ 1.001.939.298,46
JUNHO	R\$ 145.835.662,28	R\$ 856.103.636,18
JULHO	R\$ 106.078.439,32	R\$ 750.025.196,86
TOTAL	R\$ 338.752.742,83	

Nota: Acompanhamento do Saldo do FTEMP com base nos extratos de conta corrente (Regime de Caixa).

Relatório de Investimentos – Julho/2020

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO- FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	30/06/2020	31/07/2020	mai/20	jun/20	jul/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 4.956.589,10	R\$ 5.005.029,93	1,3787	0,7496	0,9773	3,1368%	5,6478%	9,6795%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 4.825.093,88	R\$ 4.851.703,91	0,5400	0,4400	0,5500	1,5378%	2,8314%	NC
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 568.901,84	R\$ 579.883,33	2,1900	1,4600	1,9300	5,6830%	3,2102%	NC
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 10.350.584,82	R\$ 10.436.617,17						

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	30/06/2020	31/07/2020	mai/20	jun/20	jul/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 477.181,89	R\$ 497.994,89	5,8200	7,8900	4,3600	19,1470%	-16,5707%	NC
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 208.813,44	R\$ 224.291,59	7,5516	9,8030	7,4124	26,8485%	-10,2835%	NC
OCCAM FIC FIA	R\$ 124.759,04	R\$ 195.223,93	8,2900	8,9700	9,9000	29,6860%	29,6860%	NC
SAFRA CONSUMO AMERICANO	R\$ 119.327,72	R\$ 179.881,46	-	0,9200	2,0200	2,9586%	2,9586%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 930.082,09	R\$ 1.097.391,87						
TOTAL GERAL	R\$ 11.280.666,91	R\$ 11.534.009,04						

Quadro 12.

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/06/2020	31/07/2020	mai/20	jun/20	jul/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.178.931,01	R\$ 2.198.452,89	0,253276	0,795405	0,895939	1,9560%	4,1481%	9,7152%
TOTAL GERAL	R\$ 2.178.931,01	R\$ 2.198.452,89						

Quadro 13.

3.4 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	30/06/2020	31/07/2020
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 11.280.666,91	R\$ 11.534.009,04
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.178.931,01	R\$ 2.198.452,89
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 13.459.597,92	R\$ 13.732.461,93

Quadro 14.

C

[Handwritten signatures]

Relatório de Investimentos – Julho/2020

3.5 Evolução dos Recursos – ALE/FPREV

Mês	Recursos ALE FPREV		Evolução		
			Mensal	Anual	12 Meses
jul/19	R\$	11.373.542,16	1,48%	17,85%	33,46%
ago/19	R\$	11.456.007,59	0,73%	18,71%	32,37%
set/19	R\$	11.774.465,04	2,78%	22,01%	30,94%
out/19	R\$	12.017.646,25	2,07%	24,53%	33,35%
nov/19	R\$	12.150.767,48	1,11%	25,91%	32,09%
dez/19	R\$	12.391.075,09	1,98%	28,40%	28,40%
jan/20	R\$	12.693.470,60	2,44%	2,44%	26,47%
fev/20	R\$	12.745.197,26	0,41%	2,86%	24,93%
mar/20	R\$	12.694.389,88	-0,40%	2,45%	22,39%
abr/20	R\$	12.933.067,87	1,88%	4,37%	15,66%
mai/20	R\$	13.078.781,12	1,13%	5,55%	19,91%
jun/20	R\$	13.459.597,92	2,91%	8,62%	20,10%
jul/20	R\$	13.732.461,93	2,03%	10,83%	20,74%

Quadro 15.

3.6 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - ASSEMBLEIA2020

10/08/2020 14:16:58

Fundo Previdenciário

Cálculo Posicionado em 31/07/2020

Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
Saldo Financeiro em 31/07/2019			11.373.542,16
08/2019	116.326,93	0,00	116.326,93
09/2019	115.124,97	0,00	115.124,97
10/2019	117.675,84	0,00	117.675,84
11/2019	116.604,44	0,00	116.604,44
12/2019	116.912,84	0,00	116.912,84
01/2020	232.286,40	0,00	232.286,40
02/2020	116.166,02	0,00	116.166,02
03/2020	116.289,97	0,00	116.289,97
04/2020	119.283,88	0,00	119.283,88
05/2020	119.498,47	0,00	119.498,47
06/2020	118.639,37	0,00	118.639,37
07/2020	118.639,37	0,00	118.639,37
Saldo Financeiro em 31/07/2020			13.732.461,93

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Item	Em 12 meses	Índice de Inflação: No Ano	IPCA No Mês
Taxa de Juros Anual:	5,8800%		
IPCA	2,3055%	0,4583%	0,3600%
Juros	5,8800%	3,3891%	0,4773%
Meta	8,3210%	3,8629%	0,8390%
Rentabilidade %	6,9250%	3,1199%	1,1458%
Rentabilidade R\$	835.471,27	400.583,36	154.224,64
Resultado %	-1,2887%	-0,7154%	+0,3043%
Resultado R\$	-168.275,02	-95.379,76	+41.300,17

Quadro 16.

Relatório de Investimentos – Julho/2020

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/06/2020	31/07/2020	mai20	jun20	jul20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 58.251.302,77	R\$ 60.518.598,07	1,1200	0,9500	1,7100	3,8262%	3,9608%	8,0412%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 96.103.503,22	R\$ 97.802.391,03	1,0721	0,9486	1,7677	3,8345%	3,4447%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 8.745,35	R\$ 4.391,15						
TOTAL	R\$ 154.363.551,34	R\$ 158.325.380,25						

Quadro 17.

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - PGJMP2020

19/08/2020 13:18:41

Fundo Previdenciário

Cálculo Posicionado em 31/07/2020

Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
			119.658.876,46
			Saldo Financeiro em 31/07/2019
08/2019	4.661.168,61	0,00	4.661.168,61
09/2019	6.692.727,22	0,00	6.692.727,22
10/2019	3.644.592,21	17.678,19	3.626.914,02
11/2019	1.219.736,18	15.030,00	1.204.706,18
12/2019	1.375.656,88	0,00	1.375.656,88
01/2020	2.720.674,05	16.316,13	2.704.357,92
02/2020	1.490.511,62	15.618,19	1.474.893,43
03/2020	1.275.904,25	16.735,98	1.259.168,27
04/2020	1.268.670,97	10.639,28	1.258.031,69
05/2020	1.482.380,96	0,00	1.482.380,96
06/2020	1.273.507,14	10.584,16	1.262.922,98
07/2020	1.272.066,06	11.829,88	1.260.236,18
			Saldo Financeiro em 31/07/2020
			158.325.380,25

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual:	5,8800%	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	2,3055%	0,4583%	0,3600%
Juros	5,8800%	3,3891%	0,4773%
Meta	8,3210%	3,8629%	0,8390%
Rentabilidade %	7,6089%	3,4988%	1,7546%
Rentabilidade R\$	10.403.339,45	5.166.450,77	2.708.281,79
Resultado %	-0,6574%	-0,3506%	+0,9080%
Resultado R\$	-972.383,09	-537.522,31	+1.413.245,58

Quadro 18.

Relatório de Investimentos – Julho/2020

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/06/2020	31/07/2020	mai/20	jun/20	jul/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 9.486.268,75	R\$ 8.560.449,26	2,1600	1,0900	0,9700	4,2753%	4,2304%	8,7497%
BRADESCO INST. ALOC. DINAMICA	R\$ 7.612.036,96	R\$ 9.578.604,04	1,1200	0,9500	1,7100	3,8262%	3,5146%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE								
TOTAL	R\$ 17.098.305,71	R\$ 18.139.053,30						

Quadro 19.

5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - DEFENSORIA2020

19/08/2020 13:20:37

Fundo Previdenciário

Cálculo Posicionado em 31/07/2020

Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
			6.490.808,31
			Saldo Financeiro em 31/07/2019
08/2019	775.936,11	0,00	775.936,11
09/2019	779.947,37	0,00	779.947,37
10/2019	784.381,09	0,00	784.381,09
11/2019	780.946,33	0,00	780.946,33
12/2019	2.476.831,17	0,00	2.476.831,17
01/2020	0,00	0,00	0,00
02/2020	814.914,53	0,00	814.914,53
03/2020	810.969,30	0,00	810.969,30
04/2020	818.197,74	0,00	818.197,74
05/2020	954.963,10	0,00	954.963,10
06/2020	808.818,93	0,00	808.818,93
07/2020	809.559,37	0,00	809.559,37
			Saldo Financeiro em 31/07/2020
			18.139.053,30

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual:	5,8800 %	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	2,3055 %	0,4583 %	0,3600 %
Juros	5,8800 %	3,3891 %	0,4773 %
Meta	8,3210 %	3,8629 %	0,8390 %
Rentabilidade %	9,0852 %	4,6776 %	1,3521 %
Rentabilidade R\$	1.032.779,95	665.221,19	231.188,22
Resultado %	+0,7055 %	+0,7844 %	+0,5089 %
Resultado R\$	+86.335,39	+115.730,03	+87.735,41

Quadro 20.

Relatório de Investimentos – Julho/2020

6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/06/2020	31/07/2020	mai/20	jun/20	jul/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 38.960.280,62	R\$ 42.303.722,42	2,1600	1,0900	0,9700	4,2753%	4,2304%	8,7642%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINAMICA RF	R\$ 1.414.548,90	R\$ 1.438.723,23	1,1200	0,9500	1,7100	3,8262%	3,0726%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 29.952,73	R\$ 7.707,23						
TOTAL	R\$ 40.404.782,25	R\$ 43.750.152,88						

Quadro 21.

6.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Govcno Amazonas / AM - TRIDUNALJUSTICA2020

19/08/2020 13:22:53

Fundo Previdenciário

Cálculo Posicionado em 31/07/2020

Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
	Saldo Financeiro em 31/07/2019		6.625.424,02
08/2019	3.884.077,90	67.916,92	3.816.160,98
09/2019	2.508.252,24	494.376,53	2.013.875,71
10/2019	2.781.927,34	277.820,43	2.504.106,91
11/2019	2.561.139,60	248.791,25	2.312.348,35
12/2019	5.065.716,87	398.911,86	4.666.805,01
01/2020	2.510.168,73	282.187,91	2.227.980,82
02/2020	2.546.041,07	248.112,69	2.297.928,38
03/2020	2.647.202,34	269.053,00	2.378.149,34
04/2020	3.365.431,19	341.730,86	3.023.700,33
05/2020	5.222.844,03	280.083,57	4.942.760,46
06/2020	2.652.044,89	345.842,60	2.306.202,29
07/2020	3.093.956,95	155.165,84	2.938.791,11
	Saldo Financeiro em 31/07/2020		43.750.152,88

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual:	5,8800 %	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	2,3055 %	0,4583 %	0,3600 %
Juros	5,8800 %	3,3891 %	0,4773 %
Meta	8,3210 %	3,8629 %	0,8390 %
Rentabilidade %	7,5814 %	4,9417 %	1,0063 %
Rentabilidade R\$	1.695.919,17	1.483.405,71	406.579,52
Resultado %	-0,6828 %	+1,0387 %	+0,1659 %
Resultado R\$	-163.796,14	+323.161,74	+67.588,07

Quadro 22.

Relatório de Investimentos – Julho/2020

7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/06/2020	31/07/2020	mai/20	jun/20	jul/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 6.735.440,58	R\$ 6.801.000,51	2,1600	1,0900	0,9700	4,2753%	4,2304%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 522.267,78						
TOTAL	R\$ 6.735.440,58	R\$ 7.323.268,29						

Quadro 23.

7.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Ciente: Governo Amazonas / AM - TRIBUNALCONTAS2020

10/08/2020 14:46:03

Fundo Previdenciário

Cálculo Posicionado em 31/07/2020

Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
			896.478,81
			Saldo Financeiro em 31/07/2019
08/2019	456.011,93	0,00	456.011,93
09/2019	526.068,24	0,00	526.068,24
10/2019	447.922,04	0,00	447.922,04
11/2019	889.854,89	0,00	889.854,89
12/2019	205.915,34	0,00	205.915,34
01/2020	696.572,08	0,00	696.572,08
02/2020	445.775,50	0,00	445.775,50
03/2020	245.127,45	0,00	245.127,45
04/2020	770.472,25	0,00	770.472,25
05/2020	446.927,24	0,00	446.927,24
06/2020	447.429,30	0,00	447.429,30
07/2020	522.267,78	0,00	522.267,78
			Saldo Financeiro em 31/07/2020
			7.323.268,29

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual:	5,8800 %	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	2,3055 %	0,4583 %	0,3600 %
Juros	5,8800 %	3,3891 %	0,4773 %
Meta	8,3210 %	3,8629 %	0,8390 %
Rentabilidade %	8,8731 %	4,7754 %	0,9734 %
Rentabilidade R\$	326.445,44	242.142,90	65.559,93
Resultado %	+0,5097 %	+0,8786 %	+0,1333 %
Resultado R\$	+20.095,75	+46.172,22	+9.050,36

Quadro 24.

Relatório de Investimentos – Julho/2020

8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM CALCULOATUARIAL2020

19/08/2020 13:26:44

Fundo Previdenciário

Cálculo Posicionado em 31/07/2020

	Saldo Financeiro em 31/07/2019		4.795.652.239,82
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
08/2019	49.779.512,92	1.988.640,85	47.790.872,07
09/2019	51.923.350,05	2.305.655,41	49.617.694,64
10/2019	48.634.602,75	2.318.685,20	46.315.917,55
11/2019	46.373.444,19	1.152.924,58	45.220.519,61
12/2019	90.119.100,38	2.223.722,41	87.895.377,97
01/2020	37.411.197,30	2.352.695,68	35.058.501,62
02/2020	54.996.430,46	5.174.174,42	49.822.256,04
03/2020	49.389.851,69	13.284.323,18	36.105.528,51
04/2020	48.215.833,84	12.930.951,76	35.284.882,08
05/2020	48.840.726,03	23.261.909,53	25.578.816,50
06/2020	38.120.534,15	4.488.693,80	33.631.840,35
07/2020	38.874.890,07	21.989.871,83	16.885.018,24
	Saldo Financeiro em 31/07/2020		5.143.387.382,91

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual:	5,8800 %	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	2,3055 %	0,4583 %	0,3600 %
Juros	5,8800 %	3,3891 %	0,4773 %
Meta	8,3210 %	3,8629 %	0,8390 %
Rentabilidade %	-3,1882 %	-8,3163 %	1,1238 %
Rentabilidade R\$	-161.472.082,09	-455.918.853,36	56.972.308,36
Resultado %	-10,6251 %	-11,7263 %	+0,2825 %
Resultado R\$	-582.472.425,64	-667.595.019,05	+14.439.538,01

Quadro 25.

Nota: Os valores de **Receita** referem-se às contribuições previdenciárias recebidas no período. Os valores de **Despesas** referem-se ao pagamento de inativos e pensionistas.

Relatório de Investimentos – Julho/2020

9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/06/2020	31/07/2020
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.894.965,92	R\$ 24.001.010,28
FUNDO BRADESCO FIC FI RF ALOC. DINÂMICA - COMPREV	R\$ 4.701.503,45	R\$ 4.868.573,00
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 0,02	R\$ 0,02
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 34.865,65	R\$ 34.865,65
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 135.132,96	R\$ 139.867,37
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 6.766.469,00	R\$ 29.044.317,32

Quadro 26.

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

Nota 2: Os valores de Disponibilidade Financeira (saldo em conta corrente) referem-se ao crédito de recursos após o horário permitido para aplicação.

9.2 Fundo Previdenciário Militares

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/06/2020	31/07/2020
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R\$ 2.954,49	R\$ 7.176.957,12
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ 8.452.806,15	R\$ 11.957.369,81
TOTAL	R\$ 19.134.326,93	R\$ 19.134.326,93

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. O valor de disponibilidade financeira em conta corrente refere-se à valores de Consignação em processo de pagamento, regularizado em agosto/2020.

9.3 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/06/2020	31/07/2020
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ -	R\$ -

Quadro 28

Nota: Os valores recebidos de Contribuição foram devidamente utilizados no pagamento das folhas de aposentados e pensionistas desse órgão.

Relatório de Investimentos – Julho/2020

9.3 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/06/2020	31/07/2020
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 421.126,38	R\$ 381.050,13
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 545.575,23	R\$ 44.803,99
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 265.103,78	R\$ 425.855,12

Quadro 29.

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/06/2020	31/07/2020
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 779.885,29	R\$ 767.313,71
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ 226.623,58	R\$ 187.137,40
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 1.006.508,87	R\$ 954.452,11

Quadro 30.

10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/06/2020	31/07/2020	mai/20	jun/20	jul/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.283.844,94	R\$ 2.190.816,32	0,2200	0,1900	0,1700	0,5811%	1,7686%	2,9560%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 41.244.840,70	R\$ 40.639.883,89	1,3787	0,7496	0,9773	3,1368%	5,6478%	7,5436%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00						
TOTAL	R\$ 42.528.686,64	R\$ 42.830.701,21						

Quadro 31.

10.2 Taxa de Administração - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/06/2020	31/07/2020	mai/20	jun/20	jul/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.088.250,91	R\$ 1.125.432,20	0,2200	0,1900	0,1700	0,5811%	1,7686%	2,9559%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 1.088.250,91	R\$ 1.125.432,20						

Quadro 32.

10.3 Taxa de Administração - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/06/2020	31/07/2020	mai/20	jun/20	jul/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 630.810,51	R\$ 679.475,74	0,2200	0,1900	0,1700	0,5811%	1,7686%	2,9559%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 630.810,51	R\$ 679.475,74						

Quadro 33.



Relatório de Investimentos – Julho/2020

10.4 Taxa de Administração – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/06/2020	31/07/2020	mai/20	jun/20	jul/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.966.605,99	R\$ 2.082.594,60	0,2200	0,1900	0,1700	0,5811%	1,7686%	2,2327%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 1.966.605,99	R\$ 2.082.594,60						

Quadro 34.

11. OUTROS RECURSOS

11.1 Tribunal de Justiça do Estado - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	30/06/2020	31/07/2020	mai/20	jun/20	jun/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 3.986.556,63	R\$ 5.129.404,57	0,2200	0,1900	0,1700	0,5811%	1,7686%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TJA	R\$ 190.681.525,39	R\$ 191.141.165,75	0,3930	0,2592	0,2410	0,8958%	2,7310%	5,2989%
BB PREV. RF IRF MI - TJA	R\$ 135.561.890,61	R\$ 135.877.642,55	0,3887	0,2567	0,2329	0,8808%	2,6906%	5,2195%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 50.158.888,99	R\$ 51.045.582,21	1,0721	0,9486	1,7677	3,8345%	3,0479%	3,0479%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 1,00						
TOTAL	R\$ 380.388.861,62	R\$ 383.193.796,08						

Quadro 35.

11.2 Tribunal de Contas do Estado - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	30/06/2020	31/07/2020	mai/20	jun/20	jul/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.528.264,23	R\$ 16.444.694,71	0,2200	0,1900	0,1700	0,6614%	1,5959%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TCE	R\$ 74.977.911,21	R\$ 57.130.319,81	0,3930	0,3930	0,2410	1,2242%	2,6208%	5,4394%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 50.158.888,99	R\$ 51.045.582,21	1,0721	0,9486	1,7677	2,9619%	1,2580%	3,0479%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 127.665.064,43	R\$ 124.620.596,73						

Quadro 36.

Nota: O estudo para verificação da segregação dos recursos do FFIN e FPREV desses órgãos foram finalizados, devendo no próximo Relatório de Investimentos os ajustes nos Controles e Relatório.




12. ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS

12.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
TÍTULOS DO TN	R\$ 649.325.268,01	11,48%	10%	100%	art. 7º, inciso I, "a"
TOTAL art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 649.325.268,01				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM I FIC FI	R\$ 135.877.642,55				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 19.690.546,75				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 181.529.262,91				
CAIXA FI BRASIL IRF M I TP RF	R\$ 248.271.485,56				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 535.189.051,03				
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 44.035.009,99	36,55%	10%	100%	art. 7º, inciso I, "b"
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 54.420.931,13				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 569.235.528,19				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 56.325.035,64				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 112.773.605,36				
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 109.613.886,14				
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 2.066.961.985,25				
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 56.966.106,31				
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.683.326,97				
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 138.550.685,46	24,32%	30%	40%	art. 7º, inciso IV, "a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 875.664.922,77				
ITAU INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 245.502.878,98				
TOTAL art. 7º, inciso IV, "a"	R\$ 1.375.367.920,49				
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 27.255.410,46	0,48%	5%	5%	art. 7º, inciso VII, "b"
TOTAL art. 7º, inciso VII, "b"	R\$ 27.255.410,46				
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 4.118.910.584,21	72,83%			

Quadro 37.

Relatório de Investimentos – Julho/2020

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 30.102.602,94	0,96%	10%	30%	art 8º, inciso I, "a"
ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FI	R\$ 24.040.384,89				
TOTAL art 8º, inciso I, "a"	R\$ 54.142.987,83				
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 9.443.993,83	24,68%	30%	30%	art 8º, inciso II, "a"
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 119.480.939,78				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 86.382.918,14				
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 91.454.024,69				
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 122.608.987,81				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 151.427.884,43				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 47.975.710,37				
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 226.187.671,35				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 238.803.808,82				
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 93.592.391,69				
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$ 43.696.543,55				
SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 64.928.538,64				
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 41.344.206,31				
OCCAM FIC FIA	R\$ 40.558.223,72				
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 17.924.881,45				
TOTAL art. 8º, inciso II, "a"	R\$ 1.395.810.724,58				
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 19.121.367,75	0,34%	1%	3%	art 8º, inciso III
TOTAL art. 8º, inciso III	R\$ 19.121.367,75				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.469.075.080,16	25,97%			

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXTERIOR	R\$ 15.419.002,92	0,27%	2,5%	10%	art 9º, inciso II
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 15.534.771,99	0,93%	2,5%		
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 36.791.247,37				
TOTAL art 9º - A	R\$ 67.745.022,28				
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 67.745.022,28	1,20%			
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 5.655.730.686,65	100,00%			

Quadro 38.

Relatório de Investimentos – Julho/2020

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% CARTEIRA	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM I FIC FI	R\$ 135.877.642,55	2,36%	20%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 19.690.546,75	0,34%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 181.529.262,91	3,16%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 875.664.922,77	15,23%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 86.382.918,14	1,50%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 15.534.771,99	0,27%	
CAIXA FI BRASIL IRF M I TP RF	R\$ 248.271.485,56	4,32%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 535.189.051,03	9,31%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 44.035.009,99	0,77%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 54.420.931,13	0,95%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 56.966.106,31	0,99%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.683.326,97	1,02%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 138.550.685,46	2,41%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 30.102.602,94	0,52%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 119.480.939,78	2,08%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 245.502.878,98	4,27%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 569.235.528,19	9,90%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 9.443.993,83	0,16%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 151.427.884,43	2,63%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 47.975.710,37	0,83%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 91.454.024,69	1,59%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 122.608.987,81	2,13%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 226.187.671,35	3,93%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 27.255.410,46	0,47%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 56.325.035,64	0,98%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 112.773.605,36	1,96%	
ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI	R\$ 24.040.384,89	0,42%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 238.803.808,82	4,15%	
SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 64.928.538,64	1,13%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 93.592.391,69	1,63%	
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$ 43.696.543,55	0,76%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 15.419.002,92	0,27%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 19.121.367,75	0,33%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 109.613.886,14	1,91%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 36.791.247,37	0,64%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 41.344.206,31	0,72%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 40.558.223,72	0,71%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 17.924.881,45	0,31%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO	R\$ 5.006.405.418,64		

Quadro 39.

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

Relatório de Investimentos – Julho/2020

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

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14	TOTAL APLICADO	CNPJ	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL DO FUNDO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 135.877.642,55	11.328.882/0001-35	R\$ 7.835.713.656,67	1,73%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	R\$ 19.690.546,75	19.523.305/0001-06	R\$ 685.876.947,75	2,87%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 181.529.262,91	13.327.340/0001-73	R\$ 2.088.485.812,29	8,69%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 875.664.922,77	25.078.994/0001-90	R\$ 10.799.663.748,52	8,11%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 86.382.918,14	29.258.294/0001-38	R\$ 921.115.521,73	9,38%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 15.534.771,99	21.470.644/0001-13	R\$ 311.035.145,91	4,99%	
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 56.966.106,31	08.246.263/0001-97	R\$ 455.010.077,37	12,52%	
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.683.326,97	20.216.216.0001/04	R\$ 831.066.921,71	7,06%	
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 138.550.685,46	28.515.874/0001-09	R\$ 1.237.407.026,84	11,20%	
BRDESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 30.102.602,94	14.099.976/0001-78	R\$ 210.420.088,24	14,31%	
BRDESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 119.480.939,78	06.988.623/0001-09	R\$ 2.138.402.416,21	5,59%	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 248.271.485,56	10.740.670/0001-06	R\$ 10.907.406.871,77	2,28%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 535.189.051,03	11.060.913/0001-10	R\$ 12.027.903.790,66	4,45%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 44.035.009,99	22.791.028/0001-27	R\$ 257.824.754,60	17,08%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 54.420.931,13	22.791.074/0001-26	R\$ 222.090.793,87	24,50%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 569.235.528,19	23.215.097/0001-55	R\$ 12.451.209.797,34	4,57%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 91.454.024,69	10.577.512/0001-79	R\$ 737.824.163,56	12,40%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 245.502.878,98	21.838.150/0001-49	R\$ 5.186.154.771,17	4,73%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 9.443.993,83	08.817.414/0001-10	R\$ 837.484.283,03	1,13%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 122.608.987,81	23.731.629/0001-07	R\$ 1.851.616.977,67	6,62%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 151.427.884,43	24.571.992/0001-75	R\$ 3.482.474.100,00	4,35%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 47.975.710,37	01.063.897/0001-65	R\$ 1.259.018.519,62	3,81%	
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$ 43.696.543,55	29.549.642/0001-26	R\$ 1.625.153.824,50	2,69%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 64.928.538,64	02.436.763/0001-05	R\$ 596.710.584,93	10,88%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 93.592.391,69	01.699.688/0001-02	R\$ 825.646.417,53	11,34%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 15.419.002,92	17.804.792/0001-50	R\$ 489.359.257,86	3,15%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 226.187.671,35	08.279.304/0001-41	R\$ 1.602.131.208,86	14,12%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 56.325.035,64	10.922.432/0001-03	R\$ 584.781.248,97	9,63%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 112.773.605,36	10.756.541/0001-06	R\$ 1.033.027.480,93	10,92%	
ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI	R\$ 24.040.384,89	06.224.719/0001-92	R\$ 157.998.562,35	15,22%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 109.613.886,14	30.659.168/0001-74	R\$ 1.804.759.615,69	6,07%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 238.803.808,82	11.977.794/0001-64	R\$ 2.366.861.217,15	10,09%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 36.791.247,37	19.436.818/0001-80	R\$ 1.193.916.889,93	3,08%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 41.344.206,31	34.791.108/0001-61	R\$ 320.862.225,06	12,89%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 40.558.223,72	11.628.883/0001-03	R\$ 782.812.250,33	5,18%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 17.924.881,45	11.458.144/0001-02	R\$ 1.176.072.141,14	1,52%	
TOTAL	R\$ 4.960.028.640,43				

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14, § 1º	TOTAL APLICADO	CNPJ	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Resolução CMN nº 3.922/2010
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 19.121.367,75	21.595.829/0001-54	486.942.789,33	3,93%	5%
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 27.255.410,46	19.719.727/0001-51	628.743.407,57	4,33%	
TOTAL	R\$ 46.376.778,21				

TOTAL	R\$ 5.006.405.418,64
--------------	-----------------------------

Quadro 40.

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

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

Relatório de Investimentos – Julho/2020

Nota 3: Art. 14 § 3º. Em caso de os limites de que tratam o caput e o § 1º deste artigo serem ultrapassados em decorrência de resgate de cotas do fundo por outros cotistas, o regime próprio de previdência social deverá adequar-se em até 120 dias. Conforme observado no fundo Icatu Vanguarda IBx FI.

Nota 4: Art. 21. § 1º As aplicações que apresentem prazos para vencimento, resgate, carência ou para conversão de cotas de fundos de investimento previstas em seu regulamento então vigente poderão ser mantidas em carteira até a respectiva data, caso superior ao prazo previsto no caput. Assim, considera-se que os fundos Caixa FI Brasil 2020 V TP RF e Caixa FI Brasil 2024 VI TP RF encontram-se enquadrados, pois o resgate dessas aplicações ocorrerá no vencimento dos TPF que compõe a carteira dos fundos, ou seja, 16/08/2020 e 16/08/2024, respectivamente.

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA JUNHO/2020) EM R\$ MI	TOTAL DE RECURSOS - ANBIMA	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (JULHO/2020)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB DTVM S.A	R\$ 1.088.104,82	R\$ 1.088.104.819.410,68	R\$ 1.314.680.065,11	0,1208%	5%
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 719.780,79	R\$ 719.780.787.876,70	R\$ 576.959.455,42	0,0802%	
BRADESCO	R\$ 516.007,65	R\$ 516.007.646.790,47	R\$ 403.783.661,46	0,0783%	
CAIXA	R\$ 369.695,08	R\$ 369.695.079.620,57	R\$ 1.542.606.030,59	0,4173%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	R\$ 290.373,27	R\$ 290.373.265.032,90	R\$ 217.636.476,80	0,0750%	
BANCO BTG	R\$ 120.671,25	R\$ 120.671.246.947,51	R\$ 238.803.808,82	0,1979%	
BANCO SAFRA	R\$ 99.444,41	R\$ 99.444.412.117,72	R\$ 165.526.501,26	0,1665%	
SULAMERICA INVESTIMENTOS	R\$ 31.091,81	R\$ 31.091.805.265,76	R\$ 17.924.881,45	0,0577%	
ICATU VANGUARDA DTVM S/A	R\$ 27.283,73	R\$ 27.283.727.653,69	R\$ 446.582.107,70	1,6368%	
AZ QUEST	R\$ 14.996,80	R\$ 14.996.795.754,87	R\$ 41.344.206,31	0,2757%	
OCCAM BRASIL	R\$ 10.325,56	R\$ 10.325.557.825,02	R\$ 40.558.223,72	0,3928%	

Quadro 41.

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

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

DISTRIBUIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR GESTOR DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS

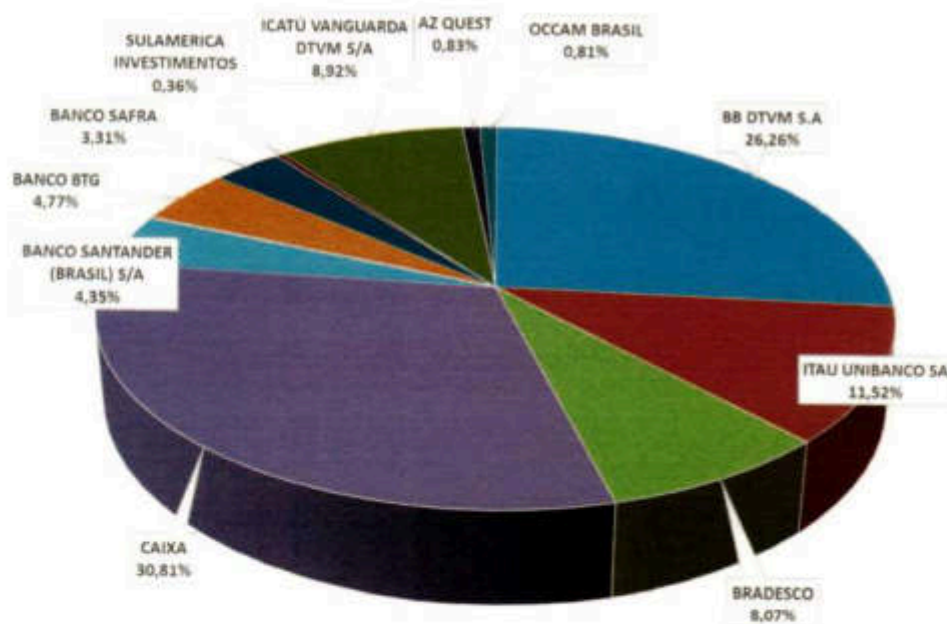


Gráfico 4.

13. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 5.006.405.398,65
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 649.325.268,01
TÍTULOS PÚBLICOS - CVS	R\$ 11.319.303,92
IMÓVEIS	R\$ 60.353.005,55
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 21.602.680,77
TOTAL	R\$ 5.749.005.656,90

Quadro 42.

EVOLUÇÃO DOS RECURSOS - AMAZONPREV

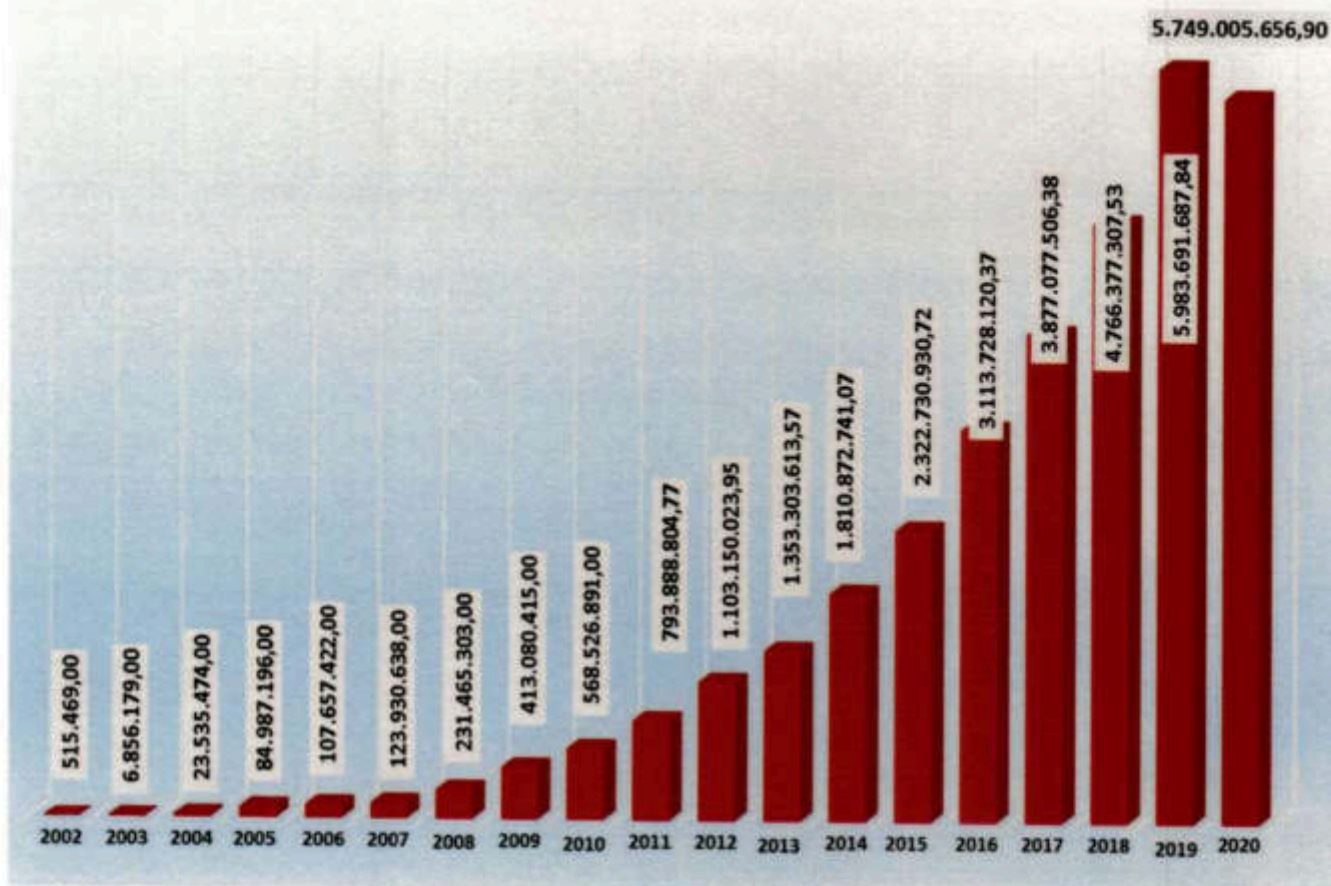


Gráfico 5.

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. O valor total a ser utilizado no FTEMP é de R\$ 1,088 bilhão, que dessa forma reduzirá os resultados da carteira de investimentos da Amazonprev.

(Handwritten mark)

(Handwritten signature)

Relatório de Investimentos – Julho/2020

14. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV EXECUTIVO:	a) Ratear os novos recursos entre os fundos: SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES (11.458.144/0001-02); BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA (11.977.794/0001-64); OCCAM FIC FIA (11.628.883/0001-03);	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/09/2020
	b) Migrar o valor de R\$ 20 milhões para fundos de Investimentos no exterior, conforme segue: 1. fundo BB Previdenciário Alocação Ativa para o fundo BB FI AÇÕES BDR NÍVEL I (21.470.644/000-13); 2. fundo SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF para o fundo SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR (19.436.818/0001-80); 3. fundo BB Previdenciário Alocação Ativa para o fundo Santander FI GLOBAL EQUITIES MULIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR (17.804.792/0001-50)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/09/2020
FPREV ALE:	Recursos Atuais: Resgatar até R\$ 2 milhões aplicados no fundo Itaú Alocação Dinâmica, distribuindo da seguinte forma: R\$ 1 milhão no fundo OCCAM FICFIA (11.628.883/0001-03), R\$ 1 milhão no fundo BTG Pactual Absoluto (11.977.794/000164)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/09/2020
FPREV MPE/PGJ:	Novos Recursos: Direcionar para o FundoFI Brasil Caixa Gestão Estratégica	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/09/2020
FPREV - DPE/AM	Novos Recursos: Direcionar para o FundoFI Brasil Caixa Gestão Estratégica	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/09/2020
FPREV - TJ/AM	Novos Recursos: Direcionar para o Fundo FI Brasil Caixa Gestão Estratégica	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/09/2020
FPREV - TCE/AM	Novos Recursos: Direcionar para o Fundo FI Brasil Caixa Gestão Estratégica	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/09/2020
FFIN (Executivo, ALE, TCE, TJA, MPE, DPE)	Aplicar os recursos no fundo Bradesco Maxi Poder Público, facilitando a operacionalização dos pagamentos das folhas de inativos e pensionistas desses órgãos. Devem ser observados os limites para aplicação conforme legislação vigente.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/09/2020
RECURSOS COMPREV	Manter os recursos aplicados no fundo Bradesco Alocação Dinâmica, de forma manter o enquadramento dos recursos da Amazonprev	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/09/2020
DISPONIBILIDADES DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	1. Poder Executivo: Manter o fundo Maxi poder Público, direcionando o residual, se houver, para o Fundo Caixa Gestão Estratégica. 2. Aos valores repassados pelos demais órgãos deve-se direcionar para o fundo Bradesco Alocação Dinâmica, com a justificativa que se trata de fundo com Gestão Ativa, por esse motivo deve manter resultado acima do CDI no Longo Prazo. Havendo necessidade, a GERA/COFIN pode solicitar transferência de valores da Caixa para o Bradesco.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/09/2020

Quadro 43.

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

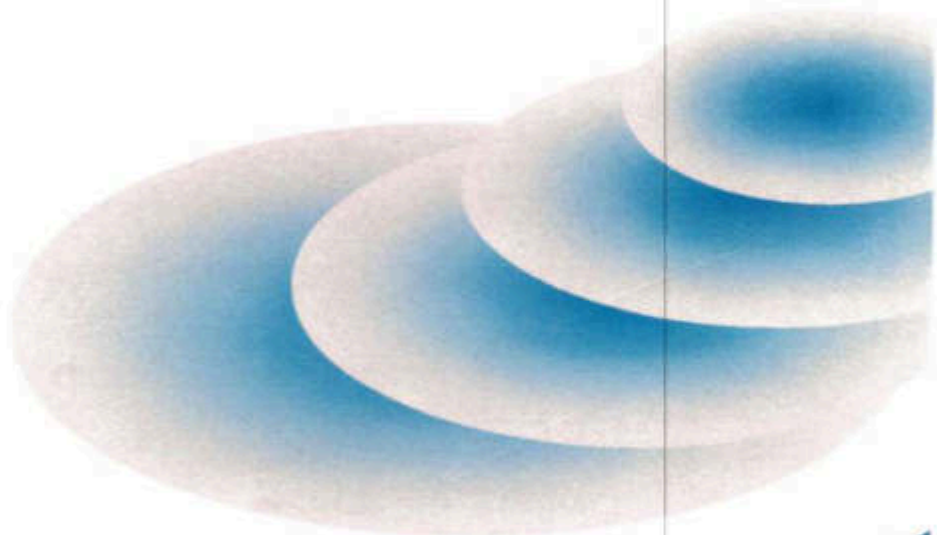


AMAZONPREV
Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



RELATÓRIOS - 2020

***RELATÓRIO DE
RISCOS
FPREV -
AMAZONPREV***



Relatório de Investimentos – Julho/2020

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL DO FUNDO	COTA DO FECHAMENTO MÊS	Volatilidade 12M	Var 95% 12M	Má Drawdown 12M	12M RETORNO	2020 RETORNO
BB Prev RF Alocação Ativo FcII	R\$ 675.771.367,31	R\$ 10.799.663.748,52	6,26%	1,51	1,09%	0,62%	-5,49	7,10%	1,77%
BB Prev RF Tr Publ VII FI	R\$ 19.690.546,75	R\$ 685.876.947,75	2,87%	1,78	0,67%	0,24%	-2,66	5,74%	0,32%
BB Prev RF Inv-B5+ Tp FI	R\$ 181.529.262,91	R\$ 2.088.485.812,29	8,69%	3,45	4,56%	1,97%	-4,84	7,68%	7,28%
Bradesco Fc FI RF Alocação Dinâmica	R\$ 63.164.341,90	R\$ 1.237.407.026,84	5,10%	1,27	1,10%	0,68%	-5,88	7,06%	1,71%
Bradesco Inst FICFI RF Inv B 5	R\$ -	R\$ 831.066.921,71	0,00%	1,98	1,02%	0,55%	-5,66	8,77%	0,97%
Bradesco FI RF Maior Poder Publico	R\$ 4.164.314,05	R\$ 455.010.077,37	0,92%	3,42	0,10%	0,01%	0,00	3,92%	0,17%
Caixa FI Brasil 2020 V Tp RF	R\$ 44.035.009,99	R\$ 257.824.754,60	17,08%	1,31	1,19%	0,40%	-2,66	-1,27%	0,07%
Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	R\$ 54.420.931,13	R\$ 222.090.793,87	24,50%	1,57	1,87%	0,95%	-10,12	5,98%	1,77%
FI Caixa Brasil Inv B 5 Tp RF LP	R\$ 535.189.051,03	R\$ 12.027.903.790,66	4,45%	3,12	1,01%	0,51%	-5,40	8,54%	0,97%
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	R\$ 523.990.614,37	R\$ 12.451.209.797,34	4,21%	1,50	0,73%	0,61%	-4,27	9,68%	0,98%
Icatu Yang FI RF Indicaco Cred Priv LP	R\$ 26.675.527,13	R\$ 628.743.407,57	4,24%	2,15	1,72%	0,61%	-6,53	6,89%	1,93%
Icatu Vanguarda Indicaco Carta FI RF LP	R\$ 56.325.035,64	R\$ 584.781.248,97	9,63%	3,47	1,03%	0,53%	-5,56	8,62%	1,02%
Icatu Yang Indicaco Longa FI RF LP	R\$ 112.773.605,36	R\$ 1.033.027.480,93	10,92%	4,45	4,60%	1,99%	-4,89	7,48%	7,35%
Icatu Inst Alocação Dinâmica RF FICFI	R\$ 240.651.175,07	R\$ 5.186.154.771,17	4,64%	18,02	0,16%	0,17%	-1,57	5,21%	0,55%
Safrin Inv Institucional Fc FI RF	R\$ 109.613.886,14	R\$ 1.804.759.615,69	6,07%	134,02	2,95%	1,46%	-13,28	10,28%	4,81%
Santander RF Ativo Fc FI	R\$ -	R\$ 977.349.938,14	0,00%	12,79	0,60%	0,18%	-1,64	6,41%	0,53%
TOTAL	R\$ 2.647.594.608,78								

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	COTA DO FECHAMENTO MÊS	Volatilidade 12M	Var 95% 12M	Má Drawdown 12M	12M RETORNO	2020 RETORNO
BB Acoes Valor Fc FIA	R\$ 86.382.918,14	R\$ 921.115.521,73	9,38%	1,31	10,71%	4,15%	-8,18	0,02%	6,38%
BB FIA Bdr Nivel I	R\$ 15.534.771,99	R\$ 311.035.145,91	4,99%	3,75	5,09%	2,74%	-17,19	50,49%	1,13%
Bradesco FIA Mid Small Caps	R\$ 119.480.939,78	R\$ 2.138.402.416,21	5,59%	10,74	12,84%	4,35%	-7,05	9,43%	8,23%
Bread Fc de FIA Institucional Inv Alpha	R\$ 30.102.602,94	R\$ 210.420.088,24	14,31%	2,01	12,15%	4,38%	-7,24	3,89%	8,43%
BTG Pactual Alocação Inst FIC FIA	R\$ 238.803.808,82	R\$ 2.366.861.217,15	10,09%	4,54	13,07%	4,56%	-6,48	12,75%	8,38%
Caixa FIA Constante	R\$ 91.229.733,10	R\$ 737.824.163,56	12,36%	2,03	13,12%	4,57%	-6,94	11,09%	7,41%
Icatu Vanguarda Acoes Ibx FI	R\$ 24.040.384,89	R\$ 157.998.562,35	15,22%	7,08	12,30%	4,50%	-7,09	3,47%	8,76%
Icatu Vanguarda Dividendos FIA	R\$ 225.689.676,46	R\$ 1.602.131.208,86	14,09%	4,99	11,09%	3,93%	-5,53	-4,41%	4,36%
Ibu Acoes Dinâmicas Fc	R\$ 151.427.864,43	R\$ 3.482.474.100,00	4,35%	19,86	12,90%	4,36%	-6,70	-0,92%	7,54%
Ibu Rpi Acoes Bovespa Ativo FICFI	R\$ 9.443.993,83	R\$ 837.484.283,03	1,13%	2,88	12,48%	4,41%	-7,27	4,30%	8,46%
Ibu Institucional Acoes Phoenix Fc FI	R\$ 122.608.987,81	R\$ 1.851.616.977,67	6,62%	2,88	16,96%	5,15%	-7,70	-12,43%	5,80%
Ibu Small Cap Master FIA	R\$ 47.975.710,37	R\$ 1.459.536.828,41	3,29%	22,06	14,29%	4,65%	-7,26	8,20%	8,75%
Santander FICFI Selecao Top Acoes	R\$ 64.928.538,64	R\$ 596.710.584,93	10,88%	26,466,32	13,28%	4,30%	-6,95	-3,20%	8,91%
Santander FI Bovespa Ativo Inst Acoes	R\$ 93.992.391,69	R\$ 825.646.417,53	11,34%	17,29	13,16%	4,09%	-6,83	-2,38%	8,65%
Santander Selecao 30 Acoes Fc	R\$ 43.696.543,55	R\$ 1.625.153.824,50	2,69%	26,311,62	13,26%	4,29%	-6,53	-3,36%	8,91%
Santander FI Global Equities Mult Io	R\$ 15.419.002,92	R\$ 489.359.257,86	3,15%	35,68	4,98%	2,21%	-19,06	56,85%	1,69%
Safrin S P Realis Pb FI Mult	R\$ 19.121.367,75	R\$ 486.942.789,33	3,93%	214,12	6,53%	3,29%	-4,32	8,83%	5,58%
Safrin Consumo Americano FIA Bdr Nivel I	R\$ 36.611.365,91	R\$ 1.193.916.889,93	3,07%	509,42	5,12%	3,13%	-22,47	40,24%	2,02%
Az-Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	R\$ 41.344.206,31	R\$ 320.862.225,06	12,89%	0,99	0,00%	0,00%	-0,93	0,00%	13,85%
Oceanic Fc de FIA	R\$ 40.362.999,80	R\$ 782.812.250,33	5,16%	3,09	11,10%	4,18%	-6,97	7,01%	9,90%
Sul America Equities FIA	R\$ 17.924.881,45	R\$ 1.176.072.141,14	1,52%	17,97	15,59%	4,74%	-7,37	-3,34%	10,71%
TOTAL	R\$ 1.835.722.690,88								

Quadro 1.

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

Relatório de Investimentos – Julho/2020

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, consequentemente, maior o risco do ativo. Já um Draw-Down igual a zero, indica que não houve desvalorização do ativo ao longo do período avaliado.

Nota 4: ÍNDICE SHARPE: Quantifica a relação entre a Volatilidade da Carteira e seu retorno excedente a um ativo livre de risco, nesse caso, o CDI. Assim, esse indicador aponta o percentual de rentabilidade que a Carteira teve acima do CDI devido à sua maior exposição ao risco. Logo, quanto maior o Sharpe, melhor o desempenho da Carteira, enquanto valores negativos significam que o CDI superou a rentabilidade da Carteira no período. Sua função é mensurar a relação risco x retorno de uma aplicação, de modo que seu valor representa quanto você ganha em termos percentuais para cada 1,00% de risco assumido acima do CDI. Valores acima de 0,5 costumam ser adequados.

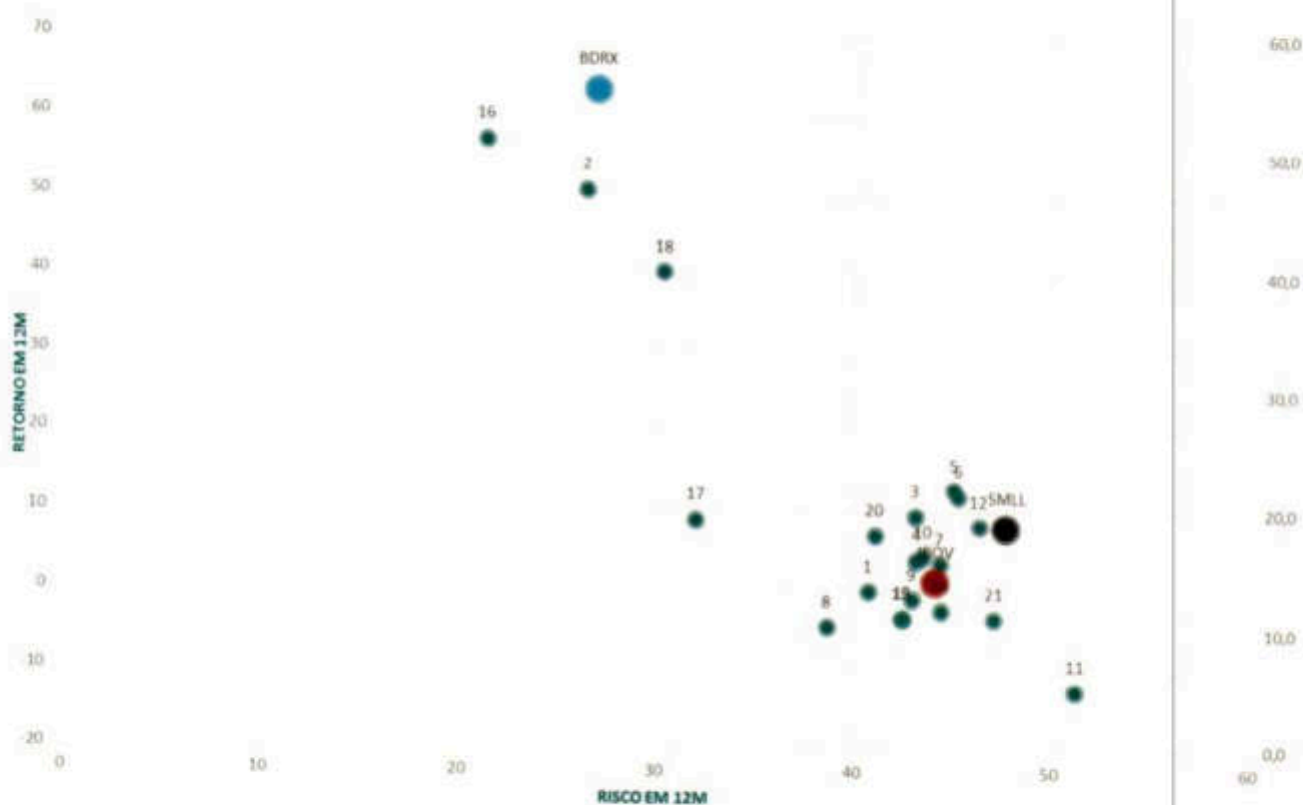


Gráfico 1: Análise Risco x Retorno

Relatório de Investimentos – Julho/2020

Nº	Fundos	Retorno	Volatilidade
1	BB Acoes Valor Fc FIA	0,02	40,77
2	BB FIA Bdr Nivel I	50,49	26,42
3	Bradesco FIA Mid Small Caps	9,43	43,13
4	Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	3,89	43,20
5	BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	12,75	45,07
6	Caixa FIA Consumo	11,99	45,31
7	Icatu Vanguarda Acoes Ibx FI	3,47	44,38
8	Icatu Vanguarda Dividendos FIA	-4,41	38,68
9	Itau Acoes Dunamis Fc	-0,92	42,98
10	Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	4,36	43,53
11	Itau Institucional Acoes Phoenix Fc FI	-12,43	51,24
12	Itau Small Cap Master FIA	8,20	46,36
13	Santander FICFI Selecao Top Acoes	-3,26	42,52
14	Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes	-2,38	44,45
15	Santander Selecao 30 Acoes Fc	-3,36	42,46
16	Santander FI Global Equities Mult Ie	56,85	21,31
17	Safra S P Reais Pb FI Mult	8,83	32,03
18	Safra Consumo Americano FIA Bdr Nivel I	40,24	30,34
19	Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA		
20	Occam Fc de FIA	7,01	41,10
21	Sul America Equities FIA	-3,34	47,14

Quadro 2. Legenda Gráfico 1.

2. VERIFICAÇÃO DE LASTRO DOS FUNDOS DE RISCO DE CRÉDITO

DATA BASE EM 31.07.20

TABELA - DURATION & YIELD POR CLASSE			
Ativo	Duration	Spread	% PL
DEB	3,22	2,18%	54,6%
CRI	0,00	0,00%	0,0%
LF	2,14	1,46%	8,6%
CDB	0,21	0,74%	0,9%
DPGE	0,00	0,00%	0,0%
NP	1,90	1,02%	1,2%
FIDC	0,00	0,00%	0,0%
NTN-B	4,51	-	20,6%
Over	0,00	-	14,2%
Carteira Crédito	3,01	2,05%	65,2%
Crédito - Contribuição Fundo	0,85	1,33%	65,2%
Fundo (Inclui DAP e NTN-B)	2,39	1,33%	100,0%

TABELA - RATING EXTERNO*		
Rating	Financeiro	% PL
AAA	118.062.047	18,8%
AA+	65.583.974	10,4%
AA	109.058.780	17,3%
AA-	28.641.809	4,6%
A+	46.481.862	7,4%
DPGE	0	0,0%
A	7.142.936	1,1%
A-	8.324.933	1,3%
BBB+	15.028.679	2,4%
BBB	0	0,0%
BBB-	3.157.623	0,5%
BB+	0	0,0%
BB	0	0,0%
BB-	8.249.027	1,3%
B+	0	0,0%
B	0	0,0%
B-	0	0,0%
CCC	0	0,0%
CC	0	0,0%
C	0	0,0%
Sem Limite	0	0,0%
Tesouro / Over	219.044.175	34,8%
Total	628.775.843	100,0%

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

Quadro 03.

Relatório de Investimentos – Julho/2020

TABELA - SETOR		
Setor	Financeiro	% PL
Elétrico	115.747.155	18,4%
Bancos	59.392.745	9,4%
Saneamento	57.304.673	9,1%
Conc. Rodoviárias	54.211.244	8,6%
Serviço	33.852.524	5,4%
Óleo e Gás	18.018.668	2,9%
Shopping Center	17.094.284	2,7%
Varejo	12.814.089	2,0%
Holding	12.739.753	2,0%
Mineração e Siderurgia	11.157.426	1,8%
Consumo	8.045.309	1,3%
Papel e Celulose	4.006.576	0,6%
Logística	2.866.128	0,5%
Infraestrutura	2.481.094	0,4%
Tesouro / Over	219.044.175	34,8%
Total	628.775.843	100,0%

Quadro 03.

Nota: Dados referentes ao fundo ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CREDITO PRIVADO LP. (base: 31/07/2020)



PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 21 de agosto de 2020, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de julho/2020, com o acompanhamento da Rentabilidade e Risco das diversas modalidades de operações realizadas nas aplicações dos recursos do RPPS.

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

Todas as operações efetuadas, foram analisadas pelo Controles Internos, e, posteriormente, aprovadas pela Diretoria, com base nas Atas de Reunião do Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev.

Manaus – AM, 21 de agosto de 2020.



Alan Nascimento
Coordenador



Bruno Costa Novo
Secretário



Bruno Barroso
Membro



Leonardo Cavalcanti
Membro



Andreza de Souza Silva
Membro



Claudinei Soares
Membro



André Luiz Bentes
Membro

APROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL - COFIS

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

APROVAÇÃO

REJEIÇÃO

Data:

Membros do Conselho Fiscal:

APROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL - CONAD

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

() APROVAÇÃO

() REJEIÇÃO

Data:

Membros do Conselho de Administração: