



GOVERNO DO ESTADO DO AMAZONAS



AMAZONPREV

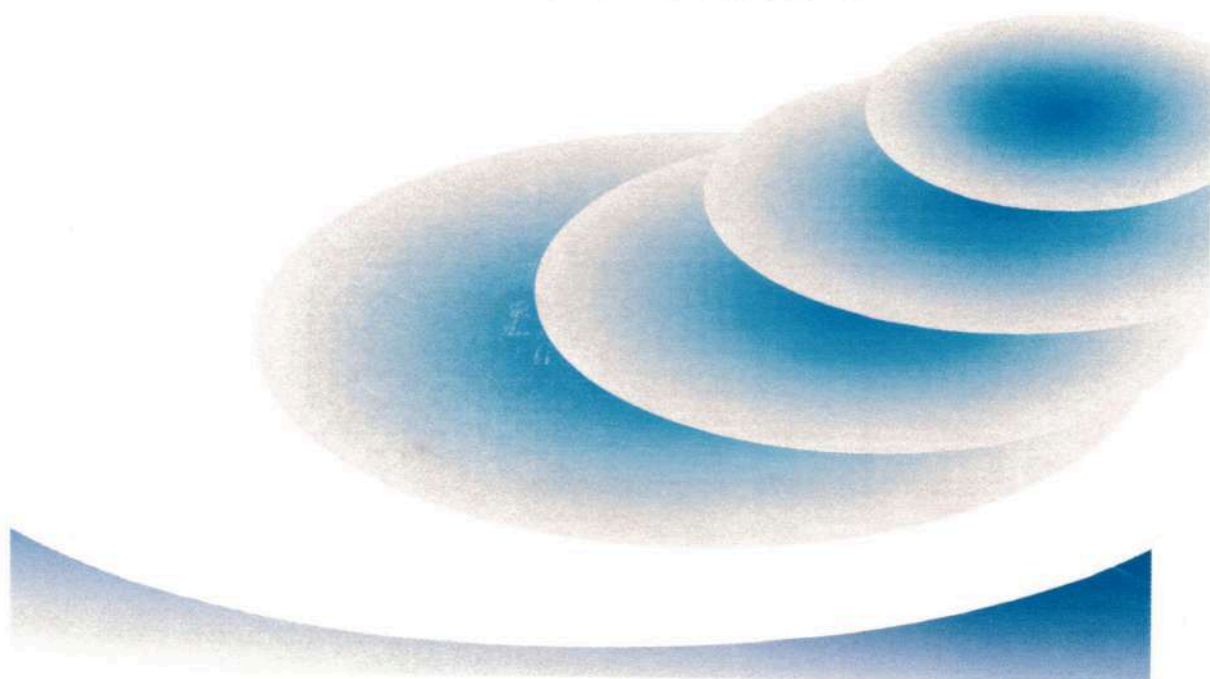
Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



RELATÓRIOS - 2020

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Outubro / 2020



Relatório de Investimentos – Outubro/2020

Destino: DIRAF / PRESI

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

Data: 16/11/2020

RELATÓRIO Nº. 038/2020 – COMIV

Senhores Diretores,

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

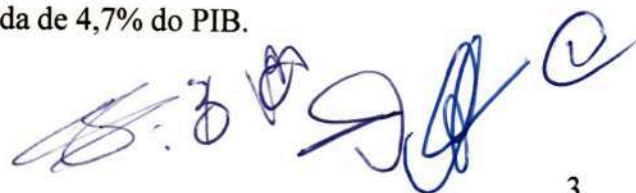
- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 03 a 07);
- 2) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Poder Executivo, apresentando os saldos e **performance** dos Fundos de Investimentos, evolução dos saldos dos Fundos de Investimentos, imóveis e CVS, comparativo da rentabilidade com a Meta Atuarial, Evolução e variação dos recursos do FPREV Executivo (páginas 08 a 14)
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 15 a 16)
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (página 17)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (página 18)
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (página 19)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (páginas 20)
- 8) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado – FPREV (página 21)
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro – (páginas 22 a 23)
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 24)
- 11) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 25 a 29)
- 12) Total dos Recursos e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 30 e 31)
- 13) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 32)
- 14) Relatório de Riscos da Carteira (página 33 a 37)
- 15) Parecer do Comitê de Investimentos (página 38).
- 16) Parecer do Comitê de Investimentos (página 39).
- 17) Parecer do Comitê de Investimentos (página 40).



1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

Com apoio dos Relatórios: Carta do Gestor – Outubro/2020 e Síntese Mensal de outubro/2020, emitidos pela BRAM Asset Management:

O Comitê de Política Monetária (Copom) manteve a taxa Selic em 2,00% a.a., e sinalizou que a taxa de juros deve permanecer próxima do patamar atual por período prolongado. No comunicado, o Comitê afirma que a forte retomada nas principais economias parece ter sofrido alguma desaceleração por conta da ressurgência da pandemia. Ademais, há incerteza frente a uma possível redução dos estímulos governamentais e à própria evolução da pandemia. Com relação à inflação, o BC ressalta que permanecem riscos em ambas as direções. De um lado, o maior nível de ociosidade, especialmente no setor de serviços, pode produzir trajetória de inflação abaixo do esperado, risco que se intensifica em ambiente de alta incerteza e maior poupança precaucional. Por outro lado, o prolongamento de medidas fiscais em resposta à pandemia que piorem a trajetória fiscal do país ou frustrações em relação às reformas podem elevar os prêmios de risco. Nesse sentido, o risco fiscal gera uma assimetria altista no balanço de riscos. Mantendo a cautela necessária por razões prudenciais e de estabilidade financeira, o Copom segue com a “prescrição futura” (o “forward guidance”) que a Selic deve permanecer onde está por período prolongado, frisando que as condições para a política seguem satisfeitas, a saber, expectativas de inflação abaixo da meta e ancoradas e regime fiscal inalterado. A Selic deva permanecer nesse patamar até pelo menos o 2º semestre de 2021. Mesmo com alta de preços no atacado, o cenário para inflação ainda segue benigno. A prévia da inflação de outubro (IPCA-15) variou 0,94%, em comparação a 0,45% na leitura de setembro, com surpresas altistas em transportes (+1,34%) e artigos de residência (+1,41%). O grupo alimentação também seguiu pressionando o índice, com inflação de 2,24%. A respeito das medidas de inflação subjacente, a média dos núcleos de inflação (exclui itens voláteis) registrou alta de 0,54% no mês e de 2,3% em 12 meses. Em nossa visão, a normalização da demanda, com a retomada de atividades interrompidas no começo da pandemia, pode manter a inflação um pouco pressionada. A projeção para 2020 é de 3,1%. Os índices de atividade econômica de agosto apontam retomada econômica, mesmo que ainda em nível abaixo do patamar pré-crise. O Índice de atividade econômica do Banco Central (IBC-Br), que atua como prévia do PIB, variou 1,1% na margem em agosto. O indicador refletiu as altas da indústria (3,6%), do comércio (4,6%) e do setor de serviços (2,9%) no mês. Na comparação interanual, houve recuo de 3,9%. O indicador se situa 4,0% abaixo do patamar pré-crise. Como apontado por indicadores de alta frequência, o 3º trimestre do ano deve registrar significativa recuperação da grande queda do PIB no 2º trimestre decorrente das medidas de contenção da epidemia. Para 2020, espera-se queda de 4,7% do PIB.



No cenário global, EUA e Zona do Euro apresentaram crescimento recorde do PIB na margem. EUA teve crescimento de 7,4% na margem no 3º trimestre, após uma queda de 9% no trimestre anterior. Por outro lado, o PIB do país ainda se mantém 3,5% abaixo do nível do final de 2019. Na Zona do Euro, o PIB do 3º trimestre mostrou expansão recorde de 12,7% na margem. Por país, o crescimento mais expressivo ocorreu na França (18,2%), seguida pela Espanha (16,7%) e Itália (16,1%). Na Alemanha, maior PIB da região, a expansão foi de 8,2%. O ritmo de continuidade da retomada econômica em ambas regiões ainda permanece incerto, dependendo do controle da pandemia e da dinâmica econômica após a retirada de estímulos fiscais. Para 2020, espera-se queda de 5,2% do PIB dos EUA, e contração de 8% para o PIB da Zona do Euro. Diante desse cenário, bancos centrais reforçaram necessidade de manutenção de política econômica acomodatória. Nos EUA, o Fed manteve a taxa de juros no intervalo de 0% a 0,25% e adotou de forma unânime a introdução da política de ‘forward guidance’. Os membros do comitê também demandaram maiores discussões sobre compra de títulos nas próximas reuniões. O comitê segue preocupado com a possibilidade de menor suporte fiscal no país, bem como com o aumento do risco financeiro decorrente do aumento da inadimplência e vulnerabilidade dos pequenos negócios nos próximos meses. Na Zona do Euro, o BCE manteve a política emergencial de compra de títulos e ativos financeiros além de manter o patamar da taxa de depósito em -0,5% a.a., da taxa de refinanciamento em 0,0% e da taxa de empréstimo em 0,25%. Na entrevista após a reunião, a presidente do BCE, Christine Lagarde, destacou que a recuperação econômica na região se torna incerta com segunda onda de COVID-19 e as novas medidas de restrição adotadas na França e Alemanha para conter a pandemia. Com essa perspectiva, o BCE indicou que a probabilidade é elevada de anunciar novos estímulos na reunião de dezembro. Na China, o PIB surpreendeu negativamente no 3º trimestre, apesar de indicadores de setembro apresentarem continuidade da recuperação. Houve alta de 4,9% na variação anual, ante queda de 3,2% no 2º trimestre. Na contramão dessa frustração com o PIB, os indicadores de setembro superaram as expectativas. A produção industrial avançou 6,9% e as vendas no varejo apresentaram crescimento de 3,3% em termos anuais. Já o dado de investimento, após recuo de 0,3% em agosto, teve expansão de 0,8%. O nível do PIB já se encontra no mesmo patamar do pré-crise. Os indicadores antecedentes mostram que essa recuperação terá continuidade. No ano, a China deverá crescer ao redor de 2,5%

Perspectiva Renda Fixa - O aumento do número de novos casos de Covid-19 na Europa e nos Estados Unidos e a consequente imposição de restrições à circulação para conter o avanço da doença, principalmente em países da Europa, podem ameaçar a recuperação em “V” vista na maior parte das economias. Entretanto, um novo pacote de estímulos está sendo desenhado com intuito de atenuar os impactos da restrição da mobilidade. Adicionalmente, os Estados Unidos entram na reta final das eleições, com milhões de americanos votando de forma antecipada devido ao Covid-19. A definição do vitorioso pode se estender além da noite subsequente ao término do prazo para votação, em razão da contestação que

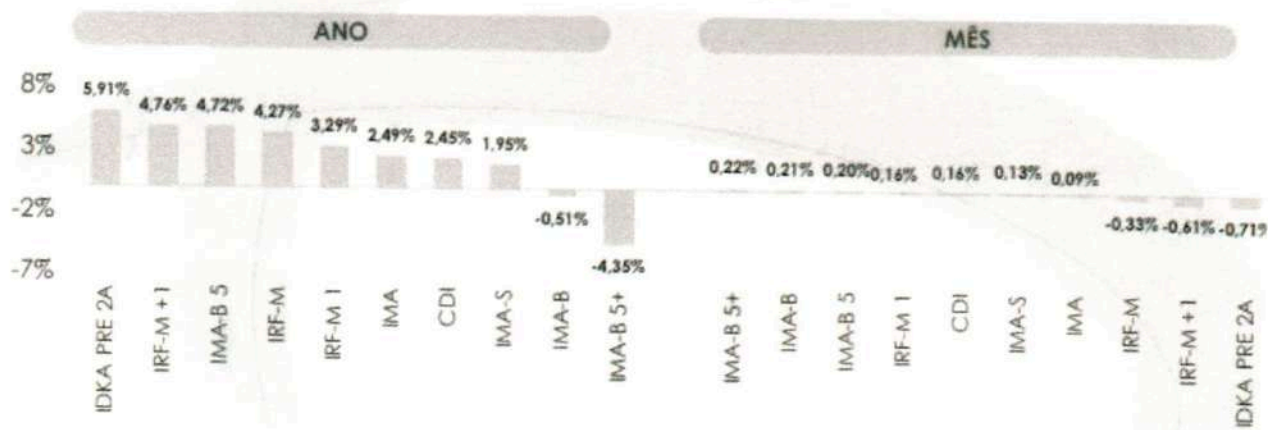


4

Relatório de Investimentos – Outubro/2020

pode ocorrer em caso de vitória democrata por uma margem pequena. No cenário local, cresce o risco de sairmos da pandemia e entrarmos em uma crise fiscal. Além disso, a medida de inflação utilizada pelo Banco Central (BC), o IPCA, tem sofrido choques advindos principalmente de alimentos e tem feito com que os agentes de mercado questionem a condução de política monetária atual. Com isso, há dois pontos relevantes que levantam suspeitas sobre a manutenção dos juros em um patamar baixo. Entretanto, a Ata do COPOM trouxe um tom mais realista, mencionando que o BC monitora com atenção a evolução dos preços, que a inflação está abaixo da meta na expectativa para 2020 e 2021 e que esse fato compensa a assimetria de riscos causada pela política fiscal. Por fim, o BC permanece com a comunicação para influenciar as expectativas de juros futuros e mantê-los baixos. O destaque do mês foi para os ativos atrelados à inflação, que tiveram resultado positivo e menor volatilidade. A inflação acima do esperado contribuiu positivamente para o resultado. Entretanto, os ativos prefixados sofreram devido ao aumento da curva de juros nominal, somente os ativos de curtíssimo prazo, até um ano, tiveram resultado positivo, fechando o mês próximos ao CDI. Por sua vez, o IMA-S, da ANBIMA, que representa todos os vencimentos do tesouro Selic ou LFTs, terminou o mês com aproximadamente 85% do resultado do CDI. Por fim, o dólar fechou a R\$ 5,77 com alta de 2,32% no mês e de 43,20% no ano.

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA FIXA



Perspectivas Renda Variável - Outubro foi mais um mês marcado pela volatilidade, a bolsa brasileira chegou a ultrapassar a barreira dos 100 mil pontos, mas no final do mês acabou sofrendo com os eventos externos.

O clima de otimismo global continuou diminuindo em outubro, pois o risco de novas ondas de contágio foi concretizado e trouxe a volta parcial de medidas de distanciamento social em alguns países europeus. Por outro lado, permanece o sentimento de menor gravidade desta nova fase, não só pelo avanço nos protocolos de tratamento, como também pela perspectiva positiva de aprovação das vacinas. A proximidade das eleições presidenciais e a não aprovação do pacote fiscal nos EUA também colaboraram para o fechamento

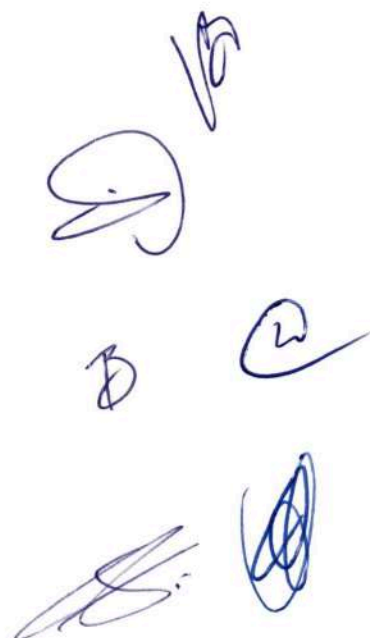
Relatório de Investimentos – Outubro/2020

menos favorável para as bolsas em outubro. Com isso, o S&P 500 teve retorno de -2,77%, mantendo resultado positivo no ano de +1,21%. O índice Nasdaq, teve retorno de -2,29%, sustentando o impressionante retorno de +21,61% no ano.

No Brasil, permanece a incerteza ligada ao desafio de reequilibrar as contas públicas, após a queda de arrecadação e o aumento de gastos proporcionados pela pandemia. Do lado positivo, dados indicam que a economia real segue em franca recuperação, justificando o otimismo da gestão para os setores com exposição à recuperação da economia doméstica com foco em empresas Mid e Small Caps (E-commerce, Locadoras, Materiais de Construção). O Ibovespa teve retorno de -0,69%, ampliando a queda no ano pra -18,76%. Apesar da piora recente, os gestores continuam com visão positiva para renda variável no médio e longo prazos, onde se pode destacar fatores como a expectativa de retomada da agenda de reformas do governo, continuidade de revisões menos negativas para o PIB, juros em patamares historicamente baixos e o fluxo do investidor local para a bolsa.

Muitos setores que se destacaram em setembro seguiram apresentando boas performances em outubro, como Bens de Capital, Papel & Celulose, Mineração & Siderurgia e Construção Civil. O setor de Bancos foi a novidade devido a expectativa de melhora nos resultados do 3º trimestre. No lado negativo, destacaram-se o setor de Educação (destaque negativo também no ano) e o setor de frigoríficos, devido ao aumento do custo da ração dos animais.

| | OUTUBRO | 2020 | 12 MESES | 24 MESES | 36 MESES |
|------------------|---------|---------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA | -0,69% | -18,76% | -12,37% | 7,47% | 26,44% |
| SMLL | -2,28% | -20,78% | -6,17% | 34,08% | 41,52% |
| IBRX | -0,55% | -17,87% | -11,05% | 11,01% | 29,92% |
| IDIV | 0,65% | -20,56% | -10,58% | 24,50% | 30,96% |
| S&P 500 (USD) | -2,77% | 1,21% | 7,65% | 20,59% | 26,98% |
| MSCI WORLD (USD) | -3,14% | -2,78% | 2,66% | 13,40% | 12,58% |



Relatório de Investimentos – Outubro/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 (%) | | | | | |
|--|-----------------------------|-----------------------------|-----------------|----------|----------|-----------|-----------|------------------|
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 | ago/20 | set/20 | out/20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA | R\$ 575.489.109,09 | R\$ 469.417.162,42 | (0,8887) | (0,7525) | (0,0702) | -1,7036% | 1,7846% | 1,7966% |
| BB PREVID TP VII | R\$ 6.859.460,43 | R\$ 6.893.243,52 | 0,4697 | 0,1909 | 0,4925 | 1,1573% | 3,1470% | 4,5444% |
| BB PREVID RF IMA B5+ | R\$ 170.207.008,47 | R\$ 170.555.613,49 | (3,6881) | (2,6465) | 0,2048 | -6,0450% | -4,6247% | NC |
| BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA | R\$ 46.947.373,20 | R\$ 26.757.228,88 | (0,8600) | (0,9800) | (0,2800) | -2,1064% | 1,3326% | 2,2007% |
| BRADESCO MAXI PODER PUBLICO | R\$ 1.998.642,51 | R\$ 2.002.826,81 | 0,1400 | (0,1100) | 0,0400 | 0,0699% | 1,8421% | 2,5626% |
| CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF | R\$ 52.661.732,79 | R\$ 52.564.187,87 | (2,4800) | (0,7700) | (0,1900) | -3,4148% | 2,0898% | 2,5783% |
| CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP | R\$ 337.876.224,25 | R\$ 338.488.590,33 | 0,3918 | (0,1593) | 0,1812 | 0,4135% | 4,4758% | 5,3785% |
| CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA | R\$ 518.053.574,53 | R\$ 517.495.053,29 | (0,5572) | (0,5032) | (0,1078) | -1,1643% | 4,4178% | 4,5042% |
| ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO | R\$ 26.770.318,15 | R\$ 26.798.548,51 | 0,5500 | (0,2000) | 0,1100 | 0,4593% | 3,6842% | 3,9848% |
| ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF | R\$ 56.388.852,96 | R\$ 56.474.082,89 | 0,3300 | (0,2200) | 0,1500 | 0,2594% | 4,3755% | 5,2666% |
| ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF | R\$ 105.790.773,97 | R\$ 105.990.944,17 | (3,6600) | (2,6200) | 0,1900 | -6,0059% | -4,6525% | -6,2243% |
| ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI | R\$ 239.800.036,42 | R\$ 239.986.126,17 | (0,1200) | (0,2300) | 0,0800 | -0,2700% | 2,5495% | 3,2557% |
| SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF | R\$ 56.520.879,96 | R\$ 56.375.412,71 | (2,0300) | (2,0900) | (0,2570) | -4,3241% | -0,2304% | -0,5451% |
| TOTAL RENDA FIXA | R\$ 2.195.363.986,73 | R\$ 2.069.799.021,06 | | | | | | |
| FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 | ago/20 | set/20 | out/20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| BB MM GLOBAL SELECT | R\$ - | R\$ 40.115.064,84 | - | - | (1,8585) | NC | NC | NC |
| BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA | R\$ 79.338.623,69 | R\$ 81.103.169,41 | (3,5538) | (4,7704) | 2,2240 | -6,1120% | -24,5045% | NC |
| BB FIA BDR NIVEL I | R\$ 69.692.089,55 | R\$ 68.481.467,06 | 14,8205 | (2,3304) | (1,7371) | 10,1967% | 14,9928% | NC |
| BRADESCO FIA MID SMALL CAPS | R\$ 111.671.243,85 | R\$ 108.919.614,81 | (1,5800) | (5,0400) | (2,4640) | -8,8433% | -16,7139% | NC |
| BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA | R\$ 27.964.610,41 | R\$ 27.905.422,74 | (2,9400) | (4,2900) | (0,2117) | -7,3005% | -15,8774% | -6,5849% |
| BTG ABSOLUTO FIQ FIA | R\$ 279.456.489,97 | R\$ 274.620.826,98 | (0,4324) | (2,9654) | (1,7304) | -5,0567% | -0,7960% | 9,0920% |
| BTG ECONOMIA REAL FIP | R\$ - | R\$ 5.647.613,82 | - | - | (0,4100) | -0,4100% | NC | NC |
| CAIXA CONSUMO FI AÇÕES | R\$ 86.134.031,93 | R\$ 83.567.882,20 | (1,5930) | (4,0572) | (2,9793) | -8,3985% | -12,7347% | -2,4351% |
| ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FI | R\$ 22.268.620,83 | R\$ 22.122.828,54 | (2,9700) | (4,5300) | (0,6500) | -7,9676% | -17,1212% | NC |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA | R\$ 203.877.747,46 | R\$ 199.768.369,45 | (4,4900) | (5,4100) | (2,0200) | -11,4820% | -26,1501% | -18,7527% |
| ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC | R\$ 143.633.002,35 | R\$ 144.348.175,94 | (0,2000) | (4,9600) | 0,5000 | -4,6758% | -18,2639% | -7,7930% |
| ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA | R\$ 8.768.811,35 | R\$ 8.652.325,33 | (3,0100) | (4,2643) | (1,3300) | -8,3809% | -17,1366% | -6,5217% |
| ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI | R\$ 108.333.638,84 | R\$ 103.816.653,82 | (3,9200) | (8,0300) | (4,1700) | -15,3200% | -35,9483% | -26,6382% |
| ITAU SMALL CAPS VALUATION | R\$ 45.182.893,06 | R\$ 44.542.646,21 | (0,9800) | (4,8800) | (1,4200) | -7,1496% | -25,7644% | NC |
| SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES | R\$ 61.029.796,02 | R\$ 59.826.457,67 | (1,8094) | (4,2726) | (1,9466) | -7,8344% | -22,5138% | -13,6957% |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES | R\$ 87.005.465,09 | R\$ 85.494.610,14 | (2,9064) | (4,2552) | (1,7365) | -8,6522% | -22,1713% | -12,9475% |
| SANTANDER SELEÇÃO 30 | R\$ 41.071.174,86 | R\$ 40.272.244,62 | (1,8110) | (4,2746) | (1,9452) | -7,8365% | -23,9787% | NC |
| SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC | R\$ 58.798.549,55 | R\$ 59.508.164,97 | 11,8461 | 0,5416 | (0,6111) | 11,7647% | 14,8867% | NC |
| SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO | R\$ 19.452.940,86 | R\$ 19.006.488,98 | 6,8600 | (4,8000) | (2,2950) | -0,6040% | -1,2347% | 7,4241% |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR | R\$ 93.841.693,56 | R\$ 92.500.829,38 | 16,0000 | (2,5300) | (1,4289) | 11,4497% | 15,8478% | NC |
| AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA | R\$ 72.419.239,42 | R\$ 70.960.848,18 | (3,1300) | (5,9500) | (2,0100) | -10,7250% | 10,3196% | NC |
| OCCAM FIC FIA | R\$ 84.696.910,25 | R\$ 84.434.250,92 | (2,2400) | (5,7200) | (0,3100) | -8,1176% | 10,0366% | NC |
| SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES | R\$ 28.704.306,88 | R\$ 27.673.836,27 | (2,0288) | (7,9400) | (3,5900) | -13,0455% | 3,9098% | NC |
| TOTAL RENDA VARIÁVEL | R\$ 1.733.341.879,78 | R\$ 1.753.289.792,28 | | | | | | |
| TOTAL GERAL | R\$ 3.928.705.866,51 | R\$ 3.823.088.813,34 | | | | | | |

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.

Relatório de Investimentos – Outubro/2020

Nota 2: Com base na Ata COMIV 167/2020, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV, em reunião ordinária, direcionando os novos recursos no fundo BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO;

Nota 3: De acordo com o Parecer nº. 1133/2020-COMIV, registra-se que para o desinvestimento das aplicações, visando cumprir os termos da LC 206/2020 – FTEMP, a partir de outubro/20, serão utilizados os recursos aplicados no fundo BB Previdência RF Alocação Ativa.

2.2 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXECUTIVO

| INSTITUIÇÃO | ago/20 | set/20 | out/20 |
|-----------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BRADERCO | R\$ 200.244.524,97 | R\$ 188.581.869,97 | R\$ 165.585.093,24 |
| BANCO DO BRASIL | R\$ 934.040.161,22 | R\$ 901.586.291,23 | R\$ 836.565.720,74 |
| CAIXA | R\$ 1.102.832.967,97 | R\$ 994.725.563,50 | R\$ 992.115.713,69 |
| ITAÚ | R\$ 565.941.432,55 | R\$ 545.718.382,02 | R\$ 541.345.927,47 |
| SANTANDER | R\$ 234.692.510,08 | R\$ 247.904.985,52 | R\$ 245.101.477,40 |
| ICATU/BEM DTVM | R\$ 430.849.952,28 | R\$ 415.096.313,37 | R\$ 411.154.773,56 |
| SAFRA | R\$ 172.561.668,03 | R\$ 169.815.514,38 | R\$ 167.882.731,07 |
| BTG PACTUAL | R\$ 274.849.491,59 | R\$ 279.456.489,97 | R\$ 280.268.440,80 |
| AZ QUEST | R\$ 77.003.842,71 | R\$ 72.419.239,42 | R\$ 70.960.848,18 |
| OCCAM BRASIL | R\$ 76.229.040,71 | R\$ 84.696.910,25 | R\$ 84.434.250,92 |
| SULAMÉRICA | R\$ 17.561.225,84 | R\$ 28.704.306,88 | R\$ 27.673.836,27 |
| TOTAL | R\$ 4.086.806.817,95 | R\$ 3.928.705.866,51 | R\$ 3.823.088.813,34 |

Quadro 2.

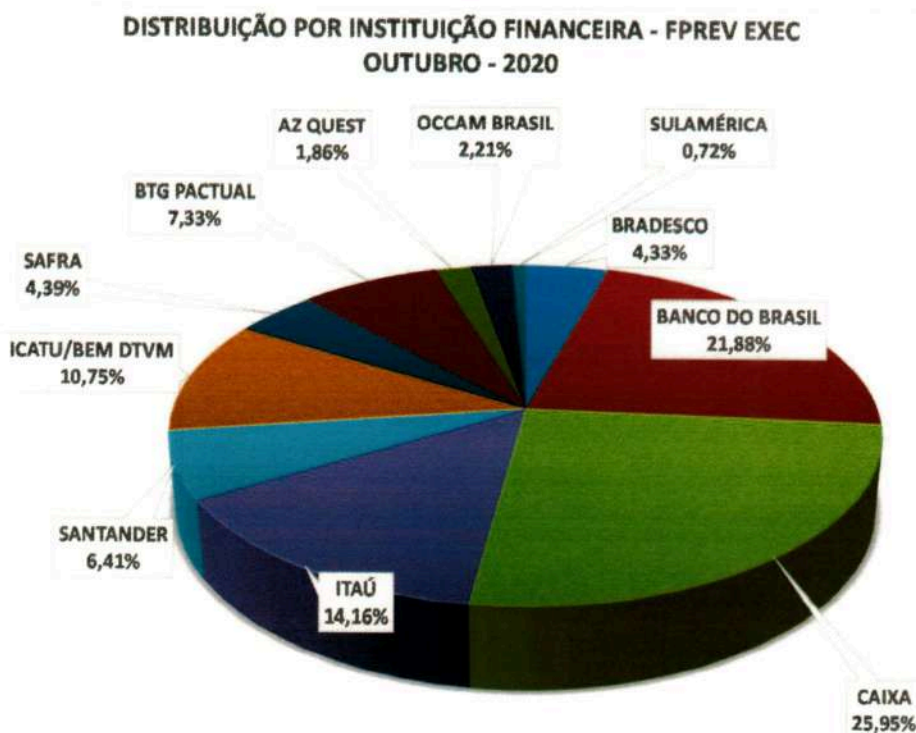


Gráfico 1

2.3 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA – FPREV EXECUTIVO

| FUNDO DE INVESTIMENTO | ÍNDICE DE REFERÊNCIA | SALDO APLICADO | % APLICADO |
|--|----------------------|-----------------------------|-------------|
| BRADESCO FI MAXI PODER PUBLICO | CDI | R\$ 2.002.826,81 | 0,05% |
| CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA BB PREVID ALOCAÇÃO ATIVA SAFRA S&P REAIS BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI SANTANDER RF ATIVO FIC | CDI ATIVO | R\$ 1.272.662.059,74 | 33,29% |
| SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF | IMA B | R\$ 56.375.412,71 | 1,47% |
| BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5 CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP ICATU VANG. FI RF INFLA. CP ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF | IMA B 5 | R\$ 421.761.221,73 | 11,03% |
| ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF BB PREVID RF IMA B5+ | IMA B5+ | R\$ 276.546.557,66 | 7,23% |
| CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF BTG ECONOMIA REAL FIP BB PREVID TP VII | IPCA + 6% | R\$ 65.105.045,21 | 1,70% |
| BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI | IBR X | R\$ 50.028.251,28 | 1,31% |
| BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA BRADESCO 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\$ 1.418.001.911,95 | 37,09% |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR BB FIA BDR NIVEL I | BDR | R\$ 160.982.296,44 | 4,21% |
| SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC BB MM GLOBAL SELECT | MSCI | R\$ 99.623.229,81 | 2,61% |
| TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO | | R\$ 3.823.088.813,34 | 100% |

Quadro 3.

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

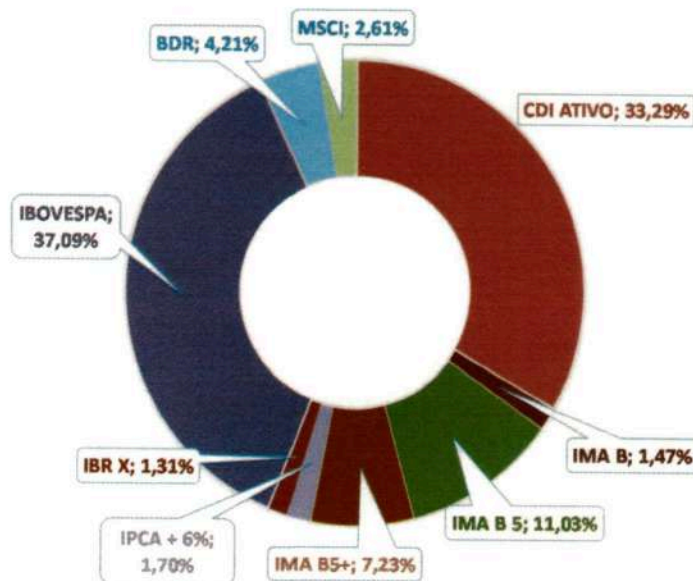


Gráfico 2.

Relatório de Investimentos – Outubro/2020

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

| TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO) | SALDO | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|---|---------------------------|---------------------------|-----------------|--------|--------|-----------|---------|------------------|
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 | ago/20 | set/20 | out/20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| NTN-B (15/01/14 - 15/05/23) | R\$ 157.639.568,46 | R\$ 159.829.351,74 | 0,7659 | 1,1680 | 1,3891 | 3,359% | 6,7596% | 9,7166% |
| NTN-B (15/01/14 - 15/08/30) | R\$ 159.847.926,69 | R\$ 162.083.573,80 | 0,7753 | 1,1774 | 1,3986 | 3,388% | 6,8496% | 9,8301% |
| NTN-B (29/01/14 - 15/08/30) | R\$ 163.589.723,95 | R\$ 165.916.581,92 | 0,7989 | 1,2011 | 1,4223 | 3,461% | 7,0752% | 10,1143% |
| NTN-B (15/01/14 - 15/08/40) | R\$ 165.732.783,58 | R\$ 168.050.763,09 | 0,7753 | 1,1774 | 1,3986 | 3,388% | 6,8498% | 9,8303% |
| TOTAL GERAL | R\$ 646.810.002,68 | R\$ 655.880.270,55 | | | | | | |

Quadro 4.

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

2.6 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

| SEGMENTO | Renda Fixa | | Renda Fixa | | Renda Fixa | | Renda Fixa | |
|--------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|------------|--|------------|--|
| TIPO DE ATIVO | NTN B | | NTN B | | NTN B | | NTN B | |
| INTERMEDIÁRIO | BRADESCO | | BRADESCO | | BRADESCO | | BRADESCO | |
| PREÇO UNITÁRIO DE COMPRA | R\$ 2.314,742871 | R\$ 2.288,539269 | R\$ 2.235,637189 | R\$ 2.254,343911 | | | | |
| QUANTIDADE | 43.100 | 43.450 | 44.113 | 44.350 | | | | |
| APLICAÇÃO INICIAL | R\$ 99.765.417,74 | R\$ 99.437.031,23 | R\$ 98.620.663,31 | R\$ 99.980.152,45 | | | | |
| VALOR ATUAL | R\$ 159.829.351,74 | R\$ 162.083.573,80 | R\$ 165.916.581,92 | R\$ 168.050.763,09 | | | | |
| 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 5.

2.7 SALDOS CVS – FPREV

| DESCRIÇÃO | SALDO | |
|--------------|--------------------------|--------------------------|
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 |
| CVS - A | R\$ 1.309.812,74 | R\$ 1.292.359,42 |
| CVS - B | R\$ 8.474.935,90 | R\$ 8.361.958,10 |
| CVS - C | R\$ 169.911,56 | R\$ 167.647,48 |
| CVS - D | R\$ 929.389,56 | R\$ 917.000,04 |
| TOTAL | R\$ 10.884.049,76 | R\$ 10.738.965,04 |

FONTE: COFIN / COMV - Relatório CETP.

Quadro 6.

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.

Relatório de Investimentos – Outubro/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 |
| ago/20 | R\$ 32.346,95 | R\$ 145.084,72 | R\$ 177.431,67 |
| set/20 | R\$ 31.926,99 | R\$ 145.084,72 | R\$ 177.011,71 |
| out/20 | R\$ 31.507,01 | R\$ 145.084,72 | R\$ 176.591,73 |
| TOTAL | R\$ 333.968,86 | R\$ 1.450.847,20 | R\$ 1.784.816,06 |

FONTE: COFIN / COMIV - Relatório CETIP.

Quadro 7.

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 |
| ago/20 | R\$ 43.635,72 | R\$ 200.728,80 | R\$ 244.364,52 |
| set/20 | R\$ 43.635,72 | R\$ - | R\$ 43.635,72 |
| out/20 | R\$ 58.180,96 | R\$ 100.364,40 | R\$ 158.545,36 |
| TOTAL | R\$ 450.902,44 | R\$ 1.003.643,60 | R\$ 1.454.546,04 |

Quadro 8.

2.10 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

| RECURSOS FPREV EXECUTIVO | SALDO | | % dos Recursos |
|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------|
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 | |
| FUNDOS DE INVESTIMENTO | R\$ 3.928.705.866,51 | R\$ 3.823.088.813,34 | 84,0169% |
| TÍTULOS PÚBLICOS | R\$ 646.810.002,68 | R\$ 655.880.270,55 | 14,4137% |
| TÍTULOS CVS | R\$ 10.884.049,76 | R\$ 10.738.965,04 | 0,2360% |
| IMÓVEIS | R\$ 60.353.005,55 | R\$ 60.353.005,55 | 1,3263% |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | R\$ 4.612.463,03 | R\$ 321.141,59 | 0,0071% |
| TOTAL | R\$ 4.651.365.387,53 | R\$ 4.550.382.196,07 | 100,00% |

Quadro 9.

Relatório de Investimentos – Outubro/2020

2.11 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS – FPREV EXECUTIVO

| Mês | Recursos FPREV Executivo | Evolução | | |
|--------|-----------------------------|----------|---------|----------|
| | | Mensal | Anual | 12 Meses |
| 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% |
| ago/20 | R\$ 4.797.635.488,57 | -2,13% | -7,27% | -0,35% |
| set/20 | R\$ 4.651.365.387,53 | -3,05% | -10,10% | -5,61% |
| out/20 | R\$ 4.550.382.196,07 | -2,17% | -12,05% | -8,41% |

Quadro 10.

2.12 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - EXECUTIVO2020

11/11/2020 14:31:57

| Fundo Previdenciário | | Cálculo Posicionado em 31/10/2020 | |
|---|-----------------|-----------------------------------|------------------|
| Mês/Ano | Receitas R\$ | Despesas R\$ | Resultado R\$ |
| | | Saldo Financeiro em 31/10/2019 | 4.927.631.461,93 |
| 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 | 98.875.947,73 | -57.002.169,92 |
| 05/2020 | 40.614.112,23 | 23.523.101,08 | 17.091.011,15 |
| 06/2020 | 32.820.094,52 | 149.967.929,32 | -117.147.834,80 |
| 07/2020 | 33.058.400,54 | 127.901.315,43 | -94.842.914,89 |
| 08/2020 | 39.455.936,02 | 98.543.877,68 | -59.087.941,66 |
| 09/2020 | 39.934.090,22 | 111.777.877,72 | -71.843.787,50 |
| 10/2020 | 39.062.286,08 | 111.082.476,30 | -72.020.190,22 |
| | | Saldo Financeiro em 31/10/2020 | 4.550.382.196,07 |
| 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 | 3,9182 % | 2,2154 % | 0,8600 % |
| Juros | 5,8800 % | 4,8765 % | 0,4773 % |
| Meta | 10,0286 % | 7,2000 % | 1,3414 % |
| Rentabilidade % | -2,9308 % | -5,3327 % | -0,6227 % |
| Rentabilidade R\$ | -146.530.461,23 | -273.906.865,57 | -28.963.001,24 |
| Resultado % | -11,7783 % | -11,6909 % | -1,9381 % |
| Resultado R\$ | -648.109.365,96 | -643.979.265,90 | -91.355.243,28 |

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, registrados sob Regime de Caixa.

Relatório de Investimentos – Outubro/2020

Nota 2: As Despesas foram revisados para inclusão do pagamento do FTEMP entre os meses de abril a agosto/2020. A correção foi necessária para ajustar os resultados do FPREV uma vez que esses recursos são utilizados como Despesas Previdenciárias.

| 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 |
| AGOSTO | R\$ 97.800.000,00 | R\$ 652.225.196,86 |
| SETEMBRO | R\$ 100.563.738,26 | R\$ 551.661.458,60 |
| OUTUBRO | R\$ 100.000.000,00 | R\$ 451.661.458,60 |
| TOTAL | R\$ 637.116.481,09 | |

Quadro 12.

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

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV ALE

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

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO | | | | | |
|--------------------------------------|--------------------------|--------------------------|-------------|----------|----------|-----------|-----------|------------------|
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 | ago/20 | set/20 | out/20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA | R\$ 4.952.101,09 | R\$ 4.946.762,14 | (0,5572) | (0,5032) | (0,1078) | -1,1643% | 4,4178% | 6,4062% |
| ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC | R\$ 842.857,63 | R\$ 86.875,96 | (0,1200) | (0,2300) | 0,0800 | -0,2700% | 2,5538% | 3,6896% |
| ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP | R\$ 1.584.695,29 | R\$ 1.729.188,46 | 0,5500 | (0,2000) | 0,1100 | 0,4593% | 3,6842% | NC |
| TOTAL RENDA FIXA | R\$ 7.379.654,01 | R\$ 6.762.826,56 | | | | | | |
| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO | | | | | |
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 | ago/20 | set/20 | out/20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA | R\$ 449.865,84 | R\$ 440.798,30 | (4,4900) | (5,4100) | (2,0200) | -11,4820% | -26,1501% | -20,2419% |
| BTG ABSOLUTO FIQ FIA | R\$ 1.431.782,05 | R\$ 1.407.006,77 | (0,4324) | (2,9654) | (1,7304) | -5,0568% | -5,0568% | NC |
| CAIXA FIA CONSUMO | R\$ 211.763,62 | R\$ 205.454,65 | (1,5930) | (4,0572) | (2,9793) | -8,3985% | -12,7347% | NC |
| OCCAM FIC FIA | R\$ 1.744.942,34 | R\$ 1.739.530,89 | (2,2400) | (5,7200) | (0,3100) | -8,1176% | 19,1586% | NC |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR | R\$ 371.314,78 | R\$ 1.105.416,81 | 16,0000 | (2,5300) | (1,4300) | 11,4484% | 14,7457% | NC |
| TOTAL RENDA VARIÁVEL | R\$ 4.209.668,63 | R\$ 4.898.207,42 | | | | | | |
| TOTAL GERAL | R\$ 11.589.322,64 | R\$ 11.661.033,98 | | | | | | |

Quadro 13.

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

| TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO) | SALDO | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|--|-------------------------|-------------------------|-----------------|----------|----------|-----------|---------|------------------|
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 | ago/20 | set/20 | out/20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| NTN-B (15/01/14 - 15/08/30) | R\$ 2.182.870,47 | R\$ 2.213.400,28 | 0,775298 | 1,177434 | 1,398600 | 3,3879% | 7,8070% | 9,6267% |
| TOTAL GERAL | R\$ 2.182.870,47 | R\$ 2.213.400,28 | | | | | | |

Quadro 14.

Relatório de Investimentos – Outubro/2020

3.3 Total dos Recursos – ALE/FPREV

| RECURSOS ALE FPREV | SALDO | |
|----------------------------|--------------------------|--------------------------|
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 |
| FUNDOS DE INVESTIMENTO | R\$ 11.589.322,64 | R\$ 11.661.033,98 |
| TÍTULOS PÚBLICOS | R\$ 2.182.870,47 | R\$ 2.213.400,28 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | R\$ - | R\$ - |
| TOTAL | R\$ 13.772.193,11 | R\$ 13.874.434,26 |

Quadro 15.

3.4 Evolução dos Recursos – ALE/FPREV

| Mês | Recursos ALE FPREV | Evolução | | |
|---------------|--------------------------|--------------|---------------|---------------|
| | | Mensal | Anual | 12 Meses |
| 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% |
| ago/20 | R\$ 13.805.725,52 | 0,53% | 11,42% | 17,25% |
| set/20 | R\$ 13.772.193,11 | -0,24% | 11,15% | 14,60% |
| out/20 | R\$ 13.874.434,26 | 0,74% | 11,97% | 14,19% |

Quadro 16.

Relatório de Investimentos – Outubro/2020

3.5 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - ASSEMBLEIA2020

11/11/2020 14:26:12

| Fundo Previdenciário | | Cálculo Posicionado em 31/10/2020 | |
|---|---------------|---------------------------------------|----------------------|
| Mês/Ano | Receitas R\$ | Despesas R\$ | Resultado R\$ |
| | | Saldo Financeiro em 31/10/2019 | 12.017.646,25 |
| 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 |
| 08/2020 | 154.104,87 | 0,00 | 154.104,87 |
| 09/2020 | 170.237,76 | 0,00 | 170.237,76 |
| 10/2020 | 143.453,76 | 0,00 | 143.453,76 |
| | | Saldo Financeiro em 31/10/2020 | 13.874.434,26 |
| 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 | 3,9182 % | 2,2154 % | 0,8600 % |
| Juros | 5,8800 % | 4,8765 % | 0,4773 % |
| Meta | 10,0286 % | 7,2000 % | 1,3414 % |
| Rentabilidade % | 1,6827 % | 0,5735 % | -0,2992 % |
| Rentabilidade R\$ | 214.670,86 | 74.759,30 | -41.212,61 |
| Resultado % | -7,5852 % | -6,1814 % | -1,6189 % |
| Resultado R\$ | -1.063.706,19 | -863.340,71 | -225.949,33 |

Quadro 17.

B

J. B. A.
B. d.

Relatório de Investimentos – Outubro/2020

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

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

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|--|---------------------------|---------------------------|-----------------|----------|----------|-----------|----------|------------------|
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 | ago/20 | set/20 | out/20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA | R\$ 2.980.227,90 | R\$ 4.468.024,33 | (0,5572) | (0,5032) | (0,1078) | -1,1643% | -1,1643% | NC |
| BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA | R\$ 59.397.540,98 | R\$ 59.223.295,72 | (0,8600) | (0,9800) | (0,2800) | -2,1064% | 1,3326% | 1,2269% |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA | R\$ 96.203.701,91 | R\$ 96.136.131,02 | (0,8887) | (0,7525) | (0,0702) | -1,7036% | 1,6824% | 3,0685% |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ 1.501,05 | R\$ 1.501,05 | | | | | | |
| TOTAL | R\$ 158.582.971,84 | R\$ 159.828.952,12 | | | | | | |

Quadro 18.

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - PGJMP2020

11/11/2020 14:34:13

| Fundo Previdenciário | | Cálculo Posicionado em 31/10/2020 | |
|---|----------------|-----------------------------------|---------------------------------------|
| Mês/Ano | Receitas R\$ | Despesas R\$ | Resultado R\$ |
| | | | Saldo Financeiro em 31/10/2019 |
| | | | 139.034.980,09 |
| 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 |
| 08/2020 | 1.482.857,02 | 9.164,74 | 1.473.692,28 |
| 09/2020 | 1.514.681,38 | 0,00 | 1.514.681,38 |
| 10/2020 | 1.490.094,20 | 0,00 | 1.490.094,20 |
| | | | Saldo Financeiro em 31/10/2020 |
| | | | 159.828.952,12 |
| 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 | 3,9182 % | 2,2154 % | 0,8600 % |
| Juros | 5,8800 % | 4,8765 % | 0,4773 % |
| Meta | 10,0286 % | 7,2000 % | 1,3414 % |
| Rentabilidade % | 2,0584 % | 1,4634 % | -0,1539 % |
| Rentabilidade R\$ | 3.033.149,68 | 2.191.554,78 | -244.113,92 |
| Resultado % | -7,2438 % | -5,3513 % | -1,4755 % |
| Resultado R\$ | -11.733.547,17 | -8.586.525,92 | -2.371.305,90 |

Quadro 19

Relatório de Investimentos – Outubro/2020

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|--|--------------------------|--------------------------|-----------------|----------|----------|-----------|----------|------------------|
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 | ago/20 | set/20 | out/20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| CAIXA GESTÃO ESTRATÉGIA | R\$ 1.890.351,04 | R\$ 2.835.759,93 | (0,5572) | (0,5032) | (0,1078) | -1,1643% | -1,1643% | NC |
| BRDESCO INST. FIC FI RF IMA B5 | R\$ 8.403.382,97 | R\$ 8.380.027,15 | (0,8600) | (0,1900) | 0,1300 | -0,9197% | 3,2717% | 4,1347% |
| BRDESCO INST. ALOC. DINAMICA | R\$ 9.601.260,43 | R\$ 9.613.291,55 | 0,4200 | (0,9800) | (0,2800) | -0,8425% | 2,6424% | 3,1742% |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | - | 3.148,78 | | | | | | |
| TOTAL | R\$ 19.894.994,44 | R\$ 20.832.227,41 | | | | | | |

Quadro 20.

5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - DEFENSORIA2020

11/11/2020 14:28:41

| Fundo Previdenciário | | Cálculo Posicionado em 31/10/2020 | |
|---|--------------|-----------------------------------|---------------------------------------|
| Mês/Ano | Receitas R\$ | Despesas R\$ | Resultado R\$ |
| | | | Saldo Financeiro em 31/10/2019 |
| | | | 9.113.108,56 |
| 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 |
| 08/2020 | 951.659,78 | 0,00 | 951.659,78 |
| 09/2020 | 950.378,64 | 0,00 | 950.378,64 |
| 10/2020 | 952.657,42 | 0,00 | 952.657,42 |
| | | | Saldo Financeiro em 31/10/2020 |
| | | | 20.832.227,41 |
| 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 | 3,9182 % | 2,2154 % | 0,8600 % |
| Juros | 5,8800 % | 4,8765 % | 0,4773 % |
| Meta | 10,0286 % | 7,2000 % | 1,3414 % |
| Rentabilidade % | 4,0944 % | 3,2550 % | -0,0775 % |
| Rentabilidade R\$ | 589.222,54 | 503.699,46 | -15.424,45 |
| Resultado % | -5,3933 % | -3,6801 % | -1,4001 % |
| Resultado R\$ | -849.105,69 | -608.679,14 | -282.290,89 |

Quadro 21.

Relatório de Investimentos – Outubro/2020

6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|--|---------------------------|---------------------------|-----------------|----------|----------|-----------|----------|------------------|
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 | ago/20 | set/20 | out/20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA | R\$ 5.799.109,38 | R\$ 8.808.536,07 | (0,5572) | (0,5032) | (0,1078) | (0,0116) | (0,0116) | NC |
| CAIXA FI BRASIL IRF-MI TP RF | R\$ 191.599.271,62 | R\$ 191.873.060,56 | 0,0965 | 0,1330 | 0,1429 | 0,0037 | 0,0061 | NC |
| BB PREV. RF IRF MI | R\$ 136.045.373,40 | R\$ 136.199.648,08 | 0,0882 | 0,0427 | 0,1133 | 0,0024 | 0,0048 | NC |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA | R\$ 50.209.481,89 | R\$ 50.174.216,10 | (0,8887) | (0,7525) | (0,0702) | (0,0170) | 0,0003 | NC |
| BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5 | R\$ 42.138.342,60 | R\$ 42.191.145,27 | 0,4200 | (0,1900) | 0,1300 | 0,0036 | 0,0461 | 5,4792% |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINAMICA RF | R\$ 1.412.325,67 | R\$ 1.408.400,35 | (0,8600) | (0,9800) | (0,2800) | (0,0211) | 0,0090 | NC |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ 29.093,07 | R\$ 29.093,07 | | | | | | |
| TOTAL | R\$ 427.232.997,63 | R\$ 430.684.099,50 | | | | | | |

Quadro 22.

6.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - TRIBUNALJUSTICA2020

11/11/2020 14:38:19

| Fundo Previdenciário | | Cálculo Posicionado em 31/10/2020 | |
|---|----------------|---------------------------------------|-----------------------|
| Mês/Ano | Receitas R\$ | Despesas R\$ | Resultado R\$ |
| | | Saldo Financeiro em 31/10/2019 | 15.027.138,35 |
| 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 |
| 08/2020 | 3.115.630,27 | 491.741,78 | 2.623.888,49 |
| 09/2020 | 381.166.785,90 | 305.986,37 | 380.860.799,53 |
| 10/2020 | 3.325.215,77 | 305.986,37 | 3.019.229,40 |
| | | Saldo Financeiro em 31/10/2020 | 430.684.099,50 |
| 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 | 3,9182 % | 2,2154 % | 0,8600 % |
| Juros | 5,8800 % | 4,8765 % | 0,4773 % |
| Meta | 10,0286 % | 7,2000 % | 1,3414 % |
| Rentabilidade % | 3,3033 % | 2,6631 % | 0,1011 % |
| Rentabilidade R\$ | 2.058.377,64 | 1.913.434,91 | 431.872,47 |
| Resultado % | -6,1123 % | -4,2322 % | -1,2239 % |
| Resultado R\$ | -4.082.284,06 | -3.199.922,51 | -5.298.923,19 |

Quadro 23.

Relatório de Investimentos – Outubro/2020

7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | | |
|--|---------------------------|---------------------------|-----------------|----------|----------|-----------|----------|------------------|--|
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 | ago/20 | set/20 | out/20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES | |
| CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA | R\$ 1.042.588,02 | R\$ 1.555.248,10 | (0,5572) | (0,5032) | (0,1078) | -1,1643% | -1,1643% | NC | |
| CAIXA FI BRASIL IRF-MI TP RF | R\$ 48.083.519,99 | R\$ 48.152.229,73 | 0,0965 | 0,1333 | 0,1429 | 0,3732% | 0,6151% | NC | |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA | R\$ 50.209.481,89 | R\$ 50.174.216,10 | (0,8887) | (0,7525) | (0,0702) | -1,7036% | 0,0340% | NC | |
| BRASESCO INST. FIC FI RF IMA B 5 | R\$ 7.340.426,12 | R\$ 7.349.624,25 | 0,4200 | (0,1900) | 0,1300 | 0,3595% | 4,6051% | 5,4792% | |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ - | R\$ 7.943,52 | | | | | | | |
| TOTAL | R\$ 106.676.016,02 | R\$ 107.239.261,70 | | | | | | | |

Quadro 24.

7.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - TRIBUNALCONTAS2020

11/11/2020 14:36:23

| Fundo Previdenciário | | Cálculo Posicionado em 31/10/2020 | |
|---|---------------|-----------------------------------|---------------------------------------|
| Mês/Ano | Receitas R\$ | Despesas R\$ | Resultado R\$ |
| | | | Saldo Financeiro em 31/10/2019 |
| | | | 2.379.604,27 |
| 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 |
| 08/2020 | 522.585,60 | 0,00 | 522.585,60 |
| 09/2020 | 99.120.333,45 | 0,00 | 99.120.333,45 |
| 10/2020 | 521.775,18 | 0,00 | 521.775,18 |
| | | | Saldo Financeiro em 31/10/2020 |
| | | | 107.239.261,70 |
| 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 | 3,9182 % | 2,2154 % | 0,8600 % |
| Juros | 5,8800 % | 4,8765 % | 0,4773 % |
| Meta | 10,0286 % | 7,2000 % | 1,3414 % |
| Rentabilidade % | 0,1821 % | -0,0418 % | 0,0389 % |
| Rentabilidade R\$ | 24.621,37 | -6.557,92 | 41.470,50 |
| Resultado % | -8,9490 % | -6,7554 % | -1,2853 % |
| Resultado R\$ | -1.291.637,34 | -1.112.849,36 | -1.389.454,67 |

Quadro 25.

8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - CALCULOATUARIAL2020

11/11/2020 14:41:01

| Fundo Previdenciário | | Cálculo Posicionado em 31/10/2020 | |
|--|---------------------|--|-------------------------|
| | | Saldo Financeiro em 31/10/2019 | 5.105.203.939,44 |
| Mês/Ano | Receitas R\$ | Despesas R\$ | Resultado R\$ |
| 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 | 99.228.317,87 | -51.012.484,03 |
| 05/2020 | 48.840.726,03 | 23.803.184,65 | 25.037.541,38 |
| 06/2020 | 38.120.534,15 | 150.324.356,08 | -112.203.821,93 |
| 07/2020 | 38.874.890,07 | 128.068.311,15 | -89.193.421,08 |
| 08/2020 | 45.682.773,56 | 99.044.784,20 | -53.362.010,64 |
| 09/2020 | 522.856.507,35 | 112.083.864,09 | 410.772.643,26 |
| 10/2020 | 45.495.482,41 | 111.388.462,67 | -65.892.980,26 |
| | | Saldo Financeiro em 31/10/2020 | 5.282.841.171,06 |
| 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 | 3,9182 % | 2,2154 % | 0,8600 % |
| Juros | 5,8800 % | 4,8765 % | 0,4773 % |
| Meta | 10,0286 % | 7,2000 % | 1,3414 % |
| Rentabilidade % | -2,6776 % | -4,9819 % | -0,5354 % |
| Rentabilidade R\$ | -140.610.418,83 | -269.229.974,74 | -28.790.409,24 |
| Resultado % | -11,5481 % | -11,3637 % | -1,8519 % |
| Resultado R\$ | -667.129.646,08 | -658.350.583,22 | -100.923.167,26 |

Quadro 26.

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: Os lançamentos das Despesas foram revisados para inclusão do pagamento do FTEMP entre os meses de abril a agosto/2020. A correção foi necessária para ajustar os resultados do FPREV uma vez que esses recursos são utilizados como Despesas Previdenciárias.

Relatório de Investimentos – Outubro/2020

9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

| DESCRIÇÃO | SALDOS | |
|---|--------------------------|-------------------------|
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 |
| FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 29.605.055,56 | R\$ 1.496.186,36 |
| FUNDO BRADESCO FIC FI RF ALOC. DINÂMICA - COMPREV | R\$ 4.948.008,45 | R\$ 5.002.608,75 |
| REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO | R\$ 0,02 | R\$ 344.375,78 |
| COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO | R\$ 34.865,65 | R\$ 34.865,65 |
| SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS | R\$ 170.827,61 | R\$ 139.901,58 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | R\$ 9.117.273,94 | R\$ 101.402,07 |
| TOTAL | R\$ 43.876.031,23 | R\$ 7.119.340,19 |

Quadro 27.

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 | |
|--|--------------------------|--------------------------|
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM | R\$ 2.640,72 | R\$ 9.464,42 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM | R\$ 1,00 | R\$ - |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FTEMP | R\$ 17.768,87 | R\$ 1.513.020,46 |
| BRADESCO DI PREMIUM - FTEMP | R\$ - | R\$ 11.096.796,58 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP | R\$ 13.571.289,22 | R\$ - |
| TOTAL | R\$ 13.591.699,81 | R\$ 12.619.281,46 |

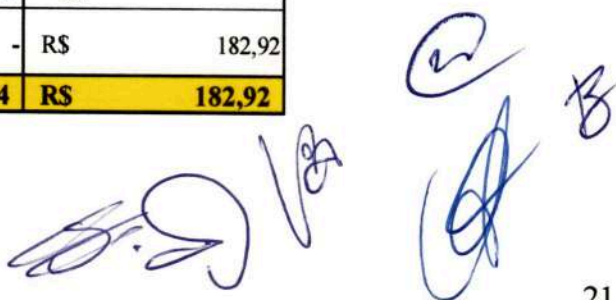
Quadro 28.

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 | |
|--|-----------------------|-------------------|
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 327.207,64 | R\$ - |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ - | R\$ 182,92 |
| TOTAL | R\$ 327.207,64 | R\$ 182,92 |

Quadro 29.



Relatório de Investimentos – Outubro/2020

9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | |
|--|-----------------------|-----------------------|
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 381.491,32 | R\$ 457.710,12 |
| DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN | R\$ 41.699,92 | R\$ 47.188,19 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ 1,00 | R\$ 1,00 |
| TOTAL | R\$ 423.192,24 | R\$ 504.899,31 |

Quadro 30.

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | |
|--|-----------------------|-----------------------|
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 264.895,61 | R\$ 627.524,18 |
| DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN | R\$ 188.042,44 | R\$ 198.120,93 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ 371.450,81 | R\$ - |
| TOTAL | R\$ 824.388,86 | R\$ 825.645,11 |

Quadro 31.

9.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | |
|--|-------------------------|-------------------------|
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 4.426.609,79 | R\$ 6.133.143,47 |
| DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN | R\$ 535.688,16 | R\$ 539.661,32 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ 1.712.088,96 | R\$ - |
| TOTAL | R\$ 6.674.386,91 | R\$ 6.672.804,79 |

Quadro 32.

9.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | |
|--|--------------------------|--------------------------|
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 16.604.287,04 | R\$ 15.407.836,78 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ 2.189.500,28 | R\$ - |
| TOTAL | R\$ 18.793.787,32 | R\$ 15.407.836,78 |

Quadro 33.

Relatório de Investimentos – Outubro/2020

10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|--|--------------------------|--------------------------|-----------------|----------|----------|-----------|---------|------------------|
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 | ago/20 | set/20 | out/20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 1.550.527,01 | R\$ 1.607.876,89 | 0,1400 | (0,1100) | 0,0400 | 0,0699% | 1,8397% | 2,5602% |
| CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA | R\$ 40.210.111,74 | R\$ 40.166.760,63 | (0,5572) | (0,5032) | (0,1078) | -1,1643% | 4,4178% | 4,5042% |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ 1,00 | R\$ 1,00 | | | | | | |
| TOTAL | R\$ 41.760.639,75 | R\$ 41.774.638,52 | | | | | | |

Quadro 34.

10.2 Taxa de Administração - ALE

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|--|-------------------------|-------------------------|-----------------|----------|--------|-----------|---------|------------------|
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 | ago/20 | set/20 | out/20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 1.194.640,92 | R\$ 1.229.437,19 | 0,1400 | (0,1100) | 0,0400 | 0,0699% | 1,8397% | 2,5602% |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ - | R\$ - | | | | | | |
| TOTAL | R\$ 1.194.640,92 | R\$ 1.229.437,19 | | | | | | |

Quadro 35.

10.3 Taxa de Administração - TCE

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|--|-----------------------|-----------------------|-----------------|----------|--------|-----------|---------|------------------|
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 | ago/20 | set/20 | out/20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 679.657,22 | R\$ 793.944,07 | 0,1400 | (0,1100) | 0,0400 | 0,0699% | 1,8397% | 2,5602% |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ - | R\$ 132,10 | | | | | | |
| TOTAL | R\$ 679.657,22 | R\$ 794.076,17 | | | | | | |

Quadro 36.

10.4 Taxa de Administração – TJ/AM

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|--|-------------------------|-------------------------|-----------------|----------|--------|-----------|---------|------------------|
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 | ago/20 | set/20 | out/20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 2.195.470,11 | R\$ 2.308.538,88 | 0,1400 | (0,1100) | 0,0400 | 0,0699% | 1,8397% | 2,5602% |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ - | R\$ - | | | | | | |
| TOTAL | R\$ 2.195.470,11 | R\$ 2.308.538,88 | | | | | | |

Quadro 37.

10.5 Taxa de Administração – PGJ/MPE

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|--|-----------------------|-----------------------|-----------------|----------|--------|-----------|---------|------------------|
| | 30/09/2020 | 31/10/2020 | ago/20 | set/20 | out/20 | TRIMESTRE | 2020 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 363.627,20 | R\$ 753.850,12 | 0,1400 | (0,1100) | 0,0400 | 0,0699% | 0,0699% | NC |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ - | R\$ - | | | | | | |
| TOTAL | R\$ 363.627,20 | R\$ 753.850,12 | | | | | | |

Quadro 38.

Relatório de Investimentos – Outubro/2020

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 2020 | | Resolução CMN nº 3.922/2010 |
|--|-----------------------------|---------------|-----------------------------------|-----------------|-----------------------------|
| | | | LIMITE ALVO | LIMITE SUPERIOR | |
| TÍTULOS DO TN | R\$ 658.093.670,83 | 12,42% | 10% | 100% | art. 7º, inciso I, "a" |
| TOTAL art. 7º, inciso I, "a" | R\$ 658.093.670,83 | | | | |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI | R\$ 136.199.648,04 | 32,90% | 10% | 100% | art. 7º, inciso I, "b" |
| BB PREVIDENCIÁRIO TP VII | R\$ 6.893.243,52 | | | | |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP | R\$ 170.555.613,49 | | | | |
| CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF | R\$ 240.025.290,29 | | | | |
| CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP | R\$ 338.488.590,33 | | | | |
| CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF | R\$ 52.564.187,87 | | | | |
| CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA | R\$ 580.276.144,49 | | | | |
| ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF | R\$ 56.474.082,89 | | | | |
| ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF | R\$ 105.990.944,17 | | | | |
| SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF | R\$ 56.375.412,71 | | | | |
| TOTAL art. 7º, inciso I, "b" | R\$ 1.743.843.157,80 | | | | |
| BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 34.341.359,75 | 20,97% | 30% | 40% | art. 7º, inciso IV, "a" |
| BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5 | R\$ 59.154.061,07 | | | | |
| BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA | R\$ 100.771.560,85 | | | | |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA | R\$ 665.901.725,63 | | | | |
| ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC | R\$ 240.073.002,13 | | | | |
| BRDESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM | R\$ 11.096.796,58 | | | | |
| TOTAL art. 7º, inciso IV, "a" | R\$ 1.111.338.506,01 | | | | |
| ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP | R\$ 28.527.736,97 | 0,54% | 5% | 5% | art. 7º, inciso VII, "b" |
| TOTAL art. 7º, inciso VII, "b" | R\$ 28.527.736,97 | | | | |
| TOTAL RENDA FIXA | R\$ 3.541.803.071,61 | 66,83% | | | |

Quadro 39.




Relatório de Investimentos – Outubro/2020

11.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Variável

| SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL | TOTAL | % DA CARTEIRA | ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020 | | Resolução CMN nº 3.922/2010 |
|--|-----------------------------|---------------|-----------------------------------|-----------------|-----------------------------|
| | | | LIMITE ALVO | LIMITE SUPERIOR | |
| BRDESCO INST IBR X ALPHA | R\$ 27.905.422,74 | 0,94% | 10% | 30% | art 8º, inciso I, "a" |
| ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI | R\$ 22.122.828,54 | | | | |
| TOTAL art 8º, inciso I, "a" | R\$ 50.028.251,28 | | | | |
| ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA | R\$ 8.652.325,33 | 26,83% | 30% | 30% | art 8º, inciso II, "a" |
| BRDESCO FIA MID SMALL CAPS | R\$ 108.919.614,81 | | | | |
| BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA | R\$ 81.103.169,41 | | | | |
| CAIXA FI AÇÕES CONSUMO | R\$ 83.773.336,85 | | | | |
| ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI | R\$ 103.816.653,82 | | | | |
| ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC | R\$ 144.348.175,94 | | | | |
| ITAÚ SMALL CAP VALUATION | R\$ 44.542.646,21 | | | | |
| ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA | R\$ 200.209.167,75 | | | | |
| BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA | R\$ 276.027.833,75 | | | | |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES | R\$ 85.494.610,14 | | | | |
| SANTANDER SELEÇÃO 30 | R\$ 40.272.244,62 | | | | |
| SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES | R\$ 59.826.457,67 | | | | |
| AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA | R\$ 70.960.848,18 | | | | |
| OCCAM FIC FIA | R\$ 86.173.781,90 | | | | |
| SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES | R\$ 27.673.836,27 | | | | |
| TOTAL art. 8º, inciso II, "a" | R\$ 1.421.794.702,65 | | | | |
| SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO | R\$ 19.006.488,98 | 0,36% | 1% | 3% | art 8º, inciso III |
| TOTAL art. 8º, inciso III | R\$ 19.006.488,98 | | | | |
| BTG ECONOMIA REAL FIP | R\$ 5.647.613,82 | 0,11% | 1% | 5% | art 8º, inciso IV, "a" |
| TOTAL art. 8º, inciso IV, "a" | R\$ 5.647.613,82 | | | | |
| TOTAL RENDA VARIÁVEL | R\$ 1.496.477.056,73 | 28,24% | | | |

| SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR | TOTAL | % DA CARTEIRA | ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020 | | Resolução CMN nº 3.922/2010 |
|--|-----------------------------|----------------|-----------------------------------|-----------------|-----------------------------|
| | | | LIMITE ALVO | LIMITE SUPERIOR | |
| BB MM GLOBAL SELECT | R\$ 40.115.064,84 | 1,88% | 2,5% | 10% | art 9º, inciso II |
| SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXTERIOR | R\$ 59.508.164,97 | | | | |
| BB FIA BDR - NIVEL I | R\$ 68.481.467,07 | 3,06% | 2,5% | | art 9º, inciso III |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I | R\$ 93.606.246,22 | | | | |
| TOTAL art 9º - A | R\$ 261.710.943,10 | | | | |
| TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | R\$ 261.710.943,10 | 4,94% | | | |
| TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES | R\$ 5.299.991.071,44 | 100,00% | | | |

Quadro 40.

Relatório de Investimentos – Outubro/2020

11.2 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 1 FIC FI | R\$ 136.199.648,04 | 2,53% | 20% |
| BB PREVIDENCIÁRIO TP VII | R\$ 6.893.243,52 | 0,13% | |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP | R\$ 170.555.613,49 | 3,17% | |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA | R\$ 665.901.725,63 | 12,39% | |
| BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA | R\$ 81.103.169,41 | 1,51% | |
| BB FIA BDR - NIVEL I | R\$ 68.481.467,07 | 1,27% | |
| BB MM GLOBAL SELECT | R\$ 40.115.064,84 | 0,75% | |
| CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF | R\$ 240.025.290,29 | 4,47% | |
| CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP | R\$ 338.488.590,33 | 6,30% | |
| CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF | R\$ 52.564.187,87 | 0,98% | |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 34.341.359,75 | 0,64% | |
| BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM | R\$ 11.096.796,58 | 0,21% | |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5 | R\$ 59.154.061,07 | 1,10% | |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA | R\$ 100.771.560,85 | 1,88% | |
| BRADESCO INST IBR X ALPHA | R\$ 27.905.422,74 | 0,52% | |
| BRADESCO FIA MID SMALL CAPS | R\$ 108.919.614,81 | 2,03% | |
| ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC | R\$ 240.073.002,13 | 4,47% | |
| CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA | R\$ 580.276.144,49 | 10,80% | |
| ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA | R\$ 8.652.325,33 | 0,16% | |
| ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC | R\$ 144.348.175,94 | 2,69% | |
| ITAÚ SMALL CAP VALUATION | R\$ 44.542.646,21 | 0,83% | |
| CAIXA FI AÇÕES CONSUMO | R\$ 83.773.336,85 | 1,56% | |
| ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI | R\$ 103.816.653,82 | 1,93% | |
| ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA | R\$ 200.209.167,75 | 3,73% | |
| ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP | R\$ 28.527.736,97 | 0,53% | |
| ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF | R\$ 56.474.082,89 | 1,05% | |
| ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF | R\$ 105.990.944,17 | 1,97% | |
| ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI | R\$ 22.122.828,54 | 0,41% | |
| BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA | R\$ 276.027.833,75 | 5,14% | |
| BTG ECONOMIA REAL FIP | R\$ 5.647.613,82 | 0,11% | |
| SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES | R\$ 59.826.457,67 | 1,11% | |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES | R\$ 85.494.610,14 | 1,59% | |
| SANTANDER SELEÇÃO 30 | R\$ 40.272.244,62 | 0,75% | |
| SANTANDER GLOBAL EQUITY | R\$ 59.508.164,97 | 1,11% | |
| SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO | R\$ 19.006.488,98 | 0,35% | |
| SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF | R\$ 56.375.412,71 | 1,05% | |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I | R\$ 93.606.246,22 | 1,74% | |
| AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA | R\$ 70.960.848,18 | 1,32% | |
| OCCAM FIC FIA | R\$ 86.173.781,90 | 1,60% | |
| SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES | R\$ 27.673.836,27 | 0,52% | |
| TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO | R\$ 4.641.897.400,61 | | |

Quadro 41.

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

Relatório de Investimentos – Outubro/2020

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

| FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14 | TOTAL APLICADO | PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$ | % DO PL DO FUNDO | Resolução CMN nº 3.922/2010 |
|---|-----------------------------|-----------------------------------|------------------|-----------------------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI | R\$ 136.199.648,04 | R\$ 7.887.722.403,08 | 1,73% | 15% |
| BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022 | R\$ 6.893.243,52 | R\$ 240.126.324,03 | 2,87% | |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP | R\$ 170.555.613,49 | R\$ 1.936.566.655,94 | 8,81% | |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA | R\$ 665.901.725,63 | R\$ 9.938.464.189,22 | 6,70% | |
| BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA | R\$ 81.103.169,41 | R\$ 866.199.541,29 | 9,36% | |
| BB FIA BDR - NIVEL I | R\$ 68.481.467,07 | R\$ 586.410.352,52 | 11,68% | |
| BB MM GLOBAL SELECT | R\$ 40.115.064,84 | R\$ 1.351.023.105,29 | 2,97% | |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 34.341.359,75 | R\$ 388.370.883,96 | 8,84% | |
| BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM | R\$ 11.096.796,58 | R\$ 3.539.135.696,53 | 0,31% | |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5 | R\$ 59.154.061,07 | R\$ 789.630.975,77 | 7,49% | |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA | R\$ 100.771.560,85 | R\$ 1.350.317.873,00 | 7,46% | |
| BRADESCO INST IBR X ALPHA | R\$ 27.905.422,74 | R\$ 187.791.281,22 | 14,86% | |
| BRADESCO FIA MID SMALL CAPS | R\$ 108.919.614,81 | R\$ 1.939.742.217,75 | 5,62% | |
| CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF | R\$ 240.025.290,29 | R\$ 11.239.080.923,98 | 2,14% | |
| CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP | R\$ 338.488.590,33 | R\$ 18.309.382.329,53 | 1,85% | |
| CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF | R\$ 52.564.187,87 | R\$ 214.513.446,45 | 24,50% | |
| CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA | R\$ 580.276.144,49 | R\$ 13.635.004.724,81 | 4,26% | |
| CAIXA FI AÇÕES CONSUMO | R\$ 83.773.336,85 | R\$ 713.552.022,73 | 11,74% | |
| ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC | R\$ 240.073.002,13 | R\$ 4.590.560.763,79 | 5,23% | |
| ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA | R\$ 8.652.325,33 | R\$ 792.105.434,37 | 1,09% | |
| ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI | R\$ 103.816.653,82 | R\$ 1.442.025.574,85 | 7,20% | |
| ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC | R\$ 144.348.175,94 | R\$ 3.130.548.860,93 | 4,61% | |
| ITAÚ SMALL CAP VALUATION | R\$ 44.542.646,21 | R\$ 1.260.783.556,57 | 3,53% | |
| SANTANDER SELEÇÃO 30 | R\$ 40.272.244,62 | R\$ 1.416.042.320,59 | 2,84% | |
| SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES | R\$ 59.826.457,67 | R\$ 515.643.080,15 | 11,60% | |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES | R\$ 85.494.610,14 | R\$ 628.622.689,65 | 13,60% | |
| SANTANDER GLOBAL EQUITY | R\$ 59.508.164,97 | R\$ 912.493.274,57 | 6,52% | |
| ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA | R\$ 200.209.167,75 | R\$ 1.361.368.675,14 | 14,71% | |
| ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF | R\$ 56.474.082,89 | R\$ 607.030.998,53 | 9,30% | |
| ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF | R\$ 105.990.944,17 | R\$ 903.541.385,63 | 11,73% | |
| ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI | R\$ 22.122.828,54 | R\$ 119.241.979,82 | 18,55% | |
| SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF | R\$ 56.375.412,71 | R\$ 1.650.990.263,48 | 3,41% | |
| BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA | R\$ 276.027.833,75 | R\$ 2.238.639.550,31 | 12,33% | |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I | R\$ 93.606.246,22 | R\$ 1.677.507.898,23 | 5,58% | |
| AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA | R\$ 70.960.848,18 | R\$ 466.432.443,07 | 15,21% | |
| OCCAM FIC FIA | R\$ 86.173.781,90 | R\$ 861.563.706,40 | 10,00% | |
| SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES | R\$ 27.673.836,27 | R\$ 1.021.463.077,32 | 2,71% | |
| TOTAL | R\$ 4.588.715.560,84 | | | |

| FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14, § 1º | TOTAL APLICADO | PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$ | % DO PL | Resolução CMN nº 3.922/2010 |
|---|--------------------------|-----------------------------------|---------|-----------------------------|
| SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO | R\$ 19.006.488,98 | 571.445.122,37 | 3,33% | 5% |
| BTG ECONOMIA REAL FIP | R\$ 5.647.613,82 | 366.190.150,46 | 1,54% | |
| ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP | R\$ 28.527.736,97 | 821.537.001,16 | 3,47% | |
| TOTAL | R\$ 53.181.839,77 | | | |

| | |
|--------------|-----------------------------|
| TOTAL | R\$ 4.641.897.400,61 |
|--------------|-----------------------------|

Quadro 42.

Relatório de Investimentos – Outubro/2020

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

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

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

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.

Nota 5: Os fundos Bradesco Institucional IBRx Alpha e AZ Quest Small Mid Caps possuem recursos aplicados da Amazonprev que superam 15% do total do Patrimônio Líquido nesses fundos. No entanto, são fundos que compram cotas de outros fundos (FIC de FI) e dessa forma não registram Desenquadramento nesse artigo, pois as informações repassadas para a SPPS através do sistema DAIR referem-se aos PLs dos fundos Master.

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

| GESTOR DE RECURSOS | TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA SETEMBRO/2020) EM R\$ MI | APLICAÇÕES - AMAZONPREV (OUTUBRO/2020) | % DE RECURSOS SOB GESTÃO | Resolução CMN nº 3.922/2010 |
|------------------------------|---|--|--------------------------|-----------------------------|
| BB DTVM S.A | R\$ 1.178.564,89 | R\$ 1.169.249.932,00 | 0,0992% | 5% |
| ITAU UNIBANCO SA | R\$ 741.349,66 | R\$ 541.432.803,43 | 0,0730% | |
| BRADESCO | R\$ 521.651,47 | R\$ 342.188.815,80 | 0,0656% | |
| CAIXA | R\$ 399.887,08 | R\$ 1.295.127.549,83 | 0,3239% | |
| BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A | R\$ 302.193,11 | R\$ 245.101.477,40 | 0,0811% | |
| BANCO BTG | R\$ 127.840,62 | R\$ 281.675.447,57 | 0,2203% | |
| BANCO SAFRA | R\$ 104.046,41 | R\$ 168.988.147,91 | 0,1624% | |
| SULAMERICA INVESTIMENTOS | R\$ 30.146,12 | R\$ 27.673.836,27 | 0,0918% | |
| ICATÚ VANGUARDA DTVM S/A | R\$ 28.629,55 | R\$ 413.324.760,32 | 1,4437% | |
| AZ QUEST | R\$ 16.145,31 | R\$ 70.960.848,18 | 0,4395% | |
| OCCAM BRASIL | R\$ 13.190,46 | R\$ 86.173.781,90 | 0,6533% | |

Quadro 43.

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

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

DISTRIBUIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR GESTOR DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS

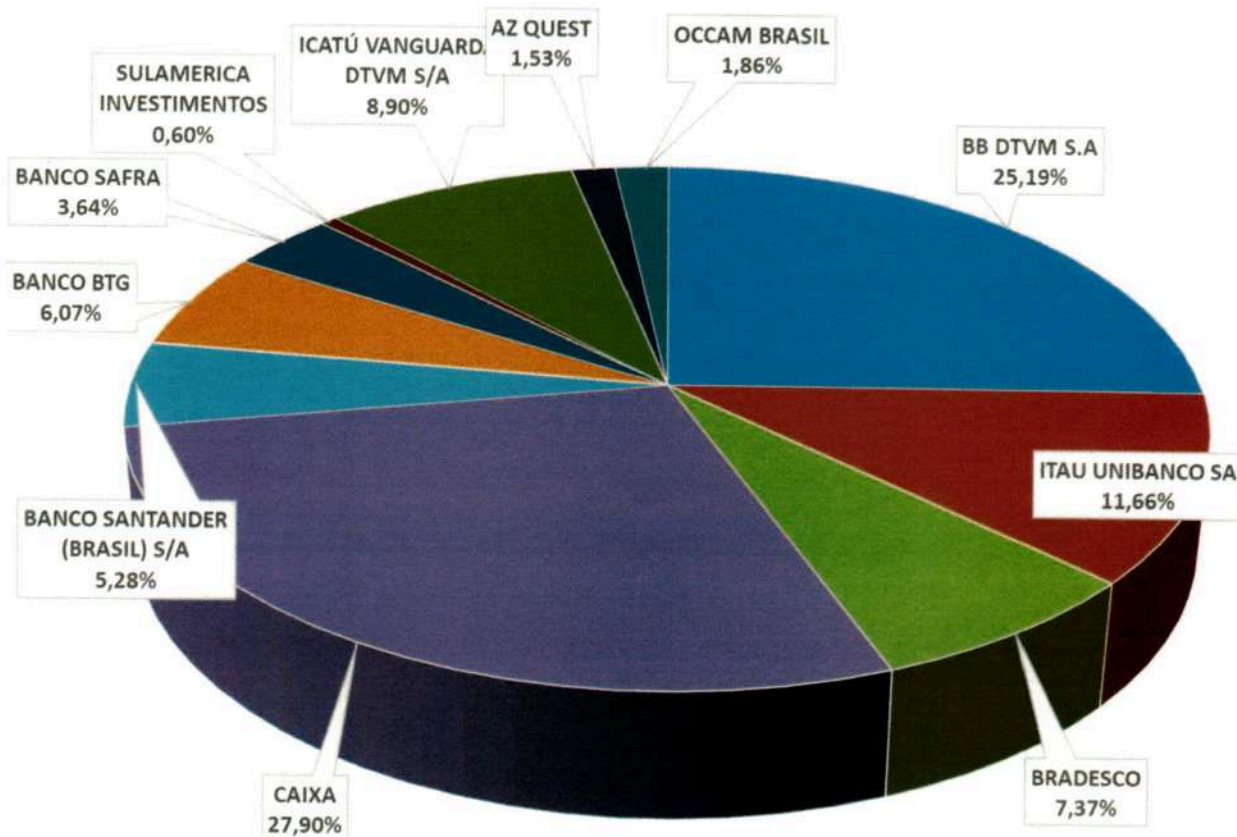


Gráfico 4.

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

| DESCRIÇÃO | SALDO |
|----------------------------|-----------------------------|
| FUNDOS DE INVESTIMENTO | R\$ 4.641.897.400,61 |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B | R\$ 658.093.670,83 |
| TÍTULOS - CVS | R\$ 10.738.965,04 |
| IMÓVEIS | R\$ 60.353.005,55 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | R\$ 1.768.660,55 |
| TOTAL | R\$ 5.372.851.702,58 |

Quadro 44.

[Handwritten signatures and initials in blue ink]

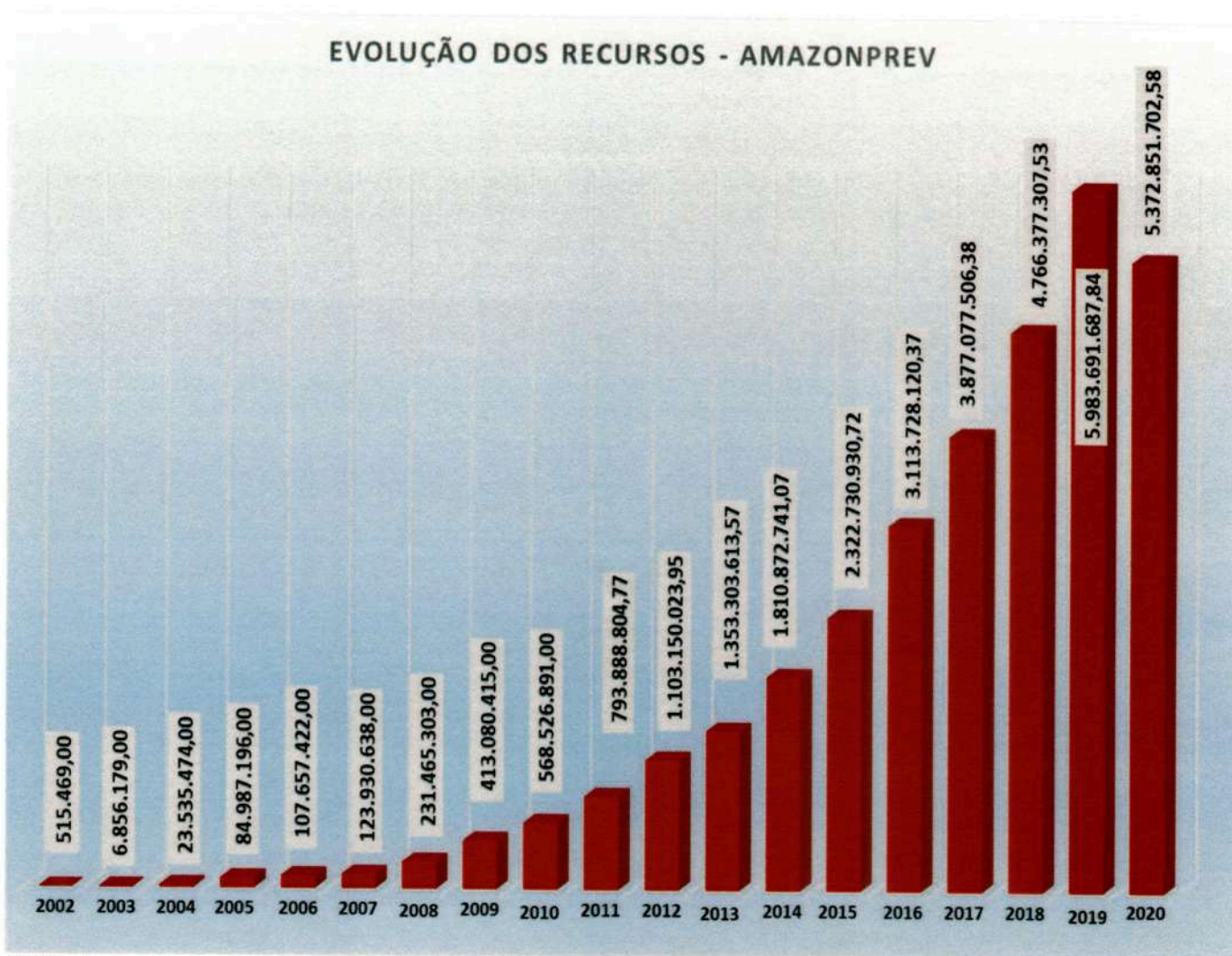


Gráfico 5.

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 signatures)

Relatório de Investimentos – Outubro/2020

13. PLANO DE AÇÃO MENSAL

| PLANO DE AÇÃO MENSAL | | RESPONSÁVEL | PRAZO |
|--|---|--|------------|
| FPREV EXECUTIVO: | Novos Recursos: Direcionar para o fundo Caixa FI Brasil IMA B5 RF TP LP (11.060.913/0001-10) | GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV | 15/12/2020 |
| FPREV ALE: | Novos Recursos: Direcionar para o Fundo CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA (23.215.097/0001-55) | GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV | 15/12/2020 |
| FPREV MPE/PGJ: | Novos Recursos: Direcionar para o Fundo CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA (23.215.097/0001-55) | GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV | 15/12/2020 |
| FPREV - DPE/AM | Novos Recursos: Direcionar para o Fundo CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA (23.215.097/0001-55) | GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV | 15/12/2020 |
| FPREV - TJ/AM | Novos Recursos: Direcionar para o Fundo CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA (23.215.097/0001-55) | GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV | 15/12/2020 |
| FPREV - TCE/AM | Novos Recursos: Direcionar para o Fundo CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA (23.215.097/0001-55) | GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV | 15/12/2020 |
| 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 | 15/12/2020 |
| 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 | 15/12/2020 |
| DISPONIBILIDADES DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO | Os Novos Recursos repassados pelo Poder Executivo, devem ser aplicados no fundo Maxi poder Público, direcionando o residual, se houver, para o Fundo Caixa Gestão Estratégica. Aos valores repassados pelos demais órgãos serão mantidas as aplicações atuais. Havendo necessidade, a GERAF/COFIN pode solicitar transferência de valores da Caixa para o Bradesco. | GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV | 15/12/2020 |

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.



GOVERNO DO ESTADO DO AMAZONAS

AMAZONPREV

Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



RELATÓRIOS - 2020

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



BD

Relatório de Investimentos – Outubro/2020

| SALDOS E PERFORMANCE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO - FPREV AMAZONPREV | Data da Últ Cotação | TOTAL APLICADO | PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$ | COTA DO FECHAMENTO MÊS | Volatilidade 12M | VaR 95% 12M | Máx Drawdown 12M | 12M | out/20 | 2020 |
|--|---------------------|-----------------------------|-----------------------------------|------------------------|------------------|-------------|------------------|---------|---------|---------|
| | | | | | | | | RETORNO | RETORNO | RETORNO |
| BB Prev RF Alocação Ativa FcFI | 09/11/2020 | R\$ 665.901.725,64 | R\$ 9.938.464.189,22 | 1,47980111 | 1,07% | 0,64% | -5,49 | 1,80% | -0,07% | 1,78% |
| BB Prev RF Tit Publi VII FI | 09/11/2020 | R\$ 6.893.243,52 | R\$ 240.126.324,03 | 1,79626213 | 0,62% | 0,25% | -2,66 | 4,54% | 0,49% | 3,15% |
| BB Prev RF Ima-B5+ Tp FI | 09/11/2020 | R\$ 170.555.613,49 | R\$ 1.936.566.655,94 | 3,24132510 | 4,45% | 2,02% | -4,84 | -6,05% | 0,20% | -4,62% |
| Bradesco Fc FI RF Alocação Dinamica | 09/11/2020 | R\$ 97.002.216,50 | R\$ 1.350.317.873,00 | 1,24779300 | 1,09% | 0,71% | -5,88 | 1,24% | -0,28% | 1,34% |
| Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5 | 09/11/2020 | R\$ 57.920.796,67 | R\$ 789.630.975,77 | 1,98983640 | 0,93% | 0,55% | -5,66 | 5,49% | 0,13% | 4,61% |
| Bradesco FI RF Maxi Poder Publico | 10/11/2020 | R\$ 2.002.826,81 | R\$ 388.370.883,96 | 3,42684650 | 0,13% | 0,03% | 0,00 | 2,57% | 0,04% | 1,84% |
| Caixa FI Brasil 2020 V Tp RF | 17/08/2020 | R\$ - | - | - | - | - | -0,12 | - | - | - |
| Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF | 09/11/2020 | R\$ 52.564.187,87 | R\$ 214.513.446,45 | 1,51961800 | 1,72% | 0,95% | -10,12 | 0,18% | -0,19% | -0,30% |
| FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP | 09/11/2020 | R\$ 338.488.590,33 | R\$ 18.309.382.329,53 | 3,13080600 | 0,92% | 0,52% | -5,40 | 5,38% | 0,18% | 4,48% |
| Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF | 09/11/2020 | R\$ 540.109.383,86 | R\$ 13.635.004.724,81 | 1,48247200 | 0,66% | 0,61% | -4,27 | 4,51% | -0,11% | 4,42% |
| Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP | 09/11/2020 | R\$ 28.527.736,97 | R\$ 821.537.001,16 | 2,16113440 | 1,67% | 0,62% | -6,53 | 4,00% | 0,11% | 3,69% |
| Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP | 09/11/2020 | R\$ 56.474.082,89 | R\$ 607.030.998,53 | 3,47849640 | 0,95% | 0,54% | -5,56 | 5,27% | 0,15% | 4,38% |
| Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP | 09/11/2020 | R\$ 105.990.944,17 | R\$ 903.541.385,63 | 4,18361200 | 4,48% | 2,04% | -4,89 | -6,24% | 0,19% | -4,67% |
| Itau Instit Alocação Dinamica RF FICFI | 09/11/2020 | R\$ 240.073.002,13 | R\$ 4.590.560.763,79 | 17,97093300 | 0,24% | 0,17% | -1,57 | 3,26% | 0,08% | 2,55% |
| Safra Ima Institucional Fc FI RF | 09/11/2020 | R\$ 56.375.412,71 | R\$ 1.650.990.263,48 | 128,23235900 | 2,90% | 1,50% | -13,28 | -0,55% | -0,26% | -0,23% |
| Santander RF Ativo Fc FI | 09/11/2020 | R\$ - | R\$ 1.027.601.722,34 | 12,72057140 | 0,27% | 0,10% | -0,55 | 2,54% | 0,00% | 1,94% |
| BB Prev RF IrfMI Tit Publi Fc | 09/11/2020 | R\$ 136.199.648,08 | R\$ 7.887.722.403,08 | 2,71127054 | 0,15% | 0,06% | -0,26 | 3,67% | 0,11% | 2,94% |
| FI Caixa Brasil IrfMI 1 Tp RF | 09/11/2020 | R\$ 240.025.290,29 | R\$ 11.237.812.745,77 | 2,59999200 | 0,14% | 0,06% | -0,25 | 3,85% | 0,14% | 3,11% |
| TOTAL | | R\$ 2.795.104.701,93 | | | | | | | | |

| FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL | Data da Últ Cotação | TOTAL APLICADO | PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$ | COTA DO FECHAMENTO MÊS | Volatilidade 12M | VaR 95% 12M | Máx Drawdown 12M | 12M | out/20 | 2020 |
|--|---------------------|-----------------------------|-----------------------------------|------------------------|------------------|-------------|------------------|---------|---------|---------|
| | | | | | | | | RETORNO | RETORNO | RETORNO |
| BB Acoes Valor Fc FIA | 09/11/2020 | R\$ 81.103.169,41 | R\$ 866.199.541,29 | 1,22721989 | 10,82% | 4,22% | -2,55 | -8,40% | 2,22% | -18,17% |
| BB Mult Global Select Equity Ie FI | 09/11/2020 | R\$ - | R\$ 1.351.023.105,29 | 4,20499442 | 5,87% | 2,70% | -22,73 | 47,29% | -1,86% | 38,32% |
| BB FIA Bdr Nivel I | 09/11/2020 | R\$ 68.481.467,06 | R\$ 586.410.352,52 | 4,13158472 | 6,21% | 2,97% | -17,19 | 56,53% | -1,74% | 45,26% |
| Bradesco FIA Mid Small Caps | 09/11/2020 | R\$ 108.919.614,81 | R\$ 1.939.742.217,75 | 9,78830490 | 12,93% | 4,42% | -3,00 | -5,27% | -2,46% | -16,71% |
| Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha | 09/11/2020 | R\$ 27.905.422,74 | R\$ 187.791.281,22 | 1,85982200 | 12,18% | 4,44% | -3,24 | -9,05% | -0,21% | -15,88% |
| BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA | 09/11/2020 | R\$ 275.726.243,79 | R\$ 2.238.639.550,31 | 4,31416450 | 13,11% | 4,61% | -3,60 | 1,35% | -1,73% | -5,68% |
| BTG Pactual Economia Real FIP | 15/08/2014 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Caixa FIA Consumo | 09/11/2020 | R\$ 84.974.888,97 | R\$ 713.552.022,73 | 1,86095400 | 13,15% | 4,64% | -3,55 | -2,43% | -2,98% | -12,73% |
| Icatu Vanguarda Acoes Ibrx FI | 09/11/2020 | R\$ 22.122.828,54 | R\$ 119.241.979,82 | 6,51541140 | 12,32% | 4,56% | -3,47 | -10,39% | -0,65% | -17,12% |
| Icatu Vanguarda Dividendos FIA | 09/11/2020 | R\$ 200.209.167,75 | R\$ 1.361.368.675,14 | 4,41248660 | 11,11% | 4,01% | -2,09 | -20,24% | -2,02% | -26,15% |
| Itau Acoes Duramis Fc | 09/11/2020 | R\$ 144.348.175,94 | R\$ 3.130.548.860,93 | 18,92843400 | 12,88% | 4,44% | -2,52 | -12,18% | 0,50% | -20,29% |
| Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI | 09/11/2020 | R\$ 8.652.325,33 | R\$ 792.105.434,37 | 2,63686200 | 12,52% | 4,47% | -3,04 | -9,12% | -1,33% | -17,14% |
| Itau Institucional Acoes Phoenix Fc FI | 09/11/2020 | R\$ 103.816.653,82 | R\$ 1.442.025.574,85 | 18,67669400 | 17,03% | 5,25% | -3,21 | -27,31% | -4,17% | -35,96% |
| Itau Small Cap Master FIA | 09/11/2020 | R\$ 44.542.646,21 | R\$ 1.260.783.556,57 | 12,87993200 | 14,30% | 4,71% | -3,21 | -6,77% | -1,25% | -20,76% |
| Santander FICFI Selecao Top Acoes | 09/11/2020 | R\$ 59.826.457,67 | R\$ 515.643.080,15 | 24,392,84585360 | 13,27% | 4,37% | -2,85 | -15,32% | -1,95% | -22,52% |
| Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes | 09/11/2020 | R\$ 85.494.610,14 | R\$ 628.622.689,65 | 15,79585620 | 13,15% | 4,57% | -2,98 | -15,46% | -1,74% | -22,61% |
| Santander Selecao 30 Acoes Fc | 09/11/2020 | R\$ 40.272.244,62 | R\$ 1.416.042.320,59 | 24,249,69503239 | 13,25% | 4,37% | -2,85 | -15,42% | -1,95% | -22,56% |
| Santander FI Global Equities Mult Ie | 09/11/2020 | R\$ 59.508.164,97 | R\$ 912.493.274,57 | 39,88206540 | 5,43% | 2,36% | -19,06 | 61,96% | -0,61% | 53,87% |
| Safra S P Reas Pb FI Mult | 09/11/2020 | R\$ 19.006.488,98 | R\$ 571.445.122,37 | 212,83640600 | 6,94% | 3,31% | -34,78 | 5,21% | -2,30% | -1,22% |
| Safra Consumo Americano FIA Bdr Nivel I | 09/11/2020 | R\$ 94.240.360,27 | R\$ 1.677.507.898,23 | 567,72123000 | 6,31% | 3,34% | -22,47 | 47,89% | -1,43% | 40,52% |
| Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA | 09/11/2020 | R\$ 70.960.848,18 | R\$ 466.432.443,07 | 0,88702080 | - | 4,84% | -0,93 | - | -2,01% | -19,61% |
| Occam Fc de FIA | 09/11/2020 | R\$ 84.639.705,57 | R\$ 861.563.706,40 | 2,84173110 | 11,19% | 4,23% | -3,75 | -7,06% | -0,31% | -12,44% |
| Sul America Equities FIA | 09/11/2020 | R\$ 27.673.836,27 | R\$ 1.021.463.077,32 | 15,62752950 | 15,68% | 4,82% | -4,16 | -20,07% | -3,59% | -28,12% |
| TOTAL | | R\$ 1.712.425.321,04 | | | | | | | | |

Quadro 1.

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

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,

Relatório de Investimentos – Outubro/2020

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.

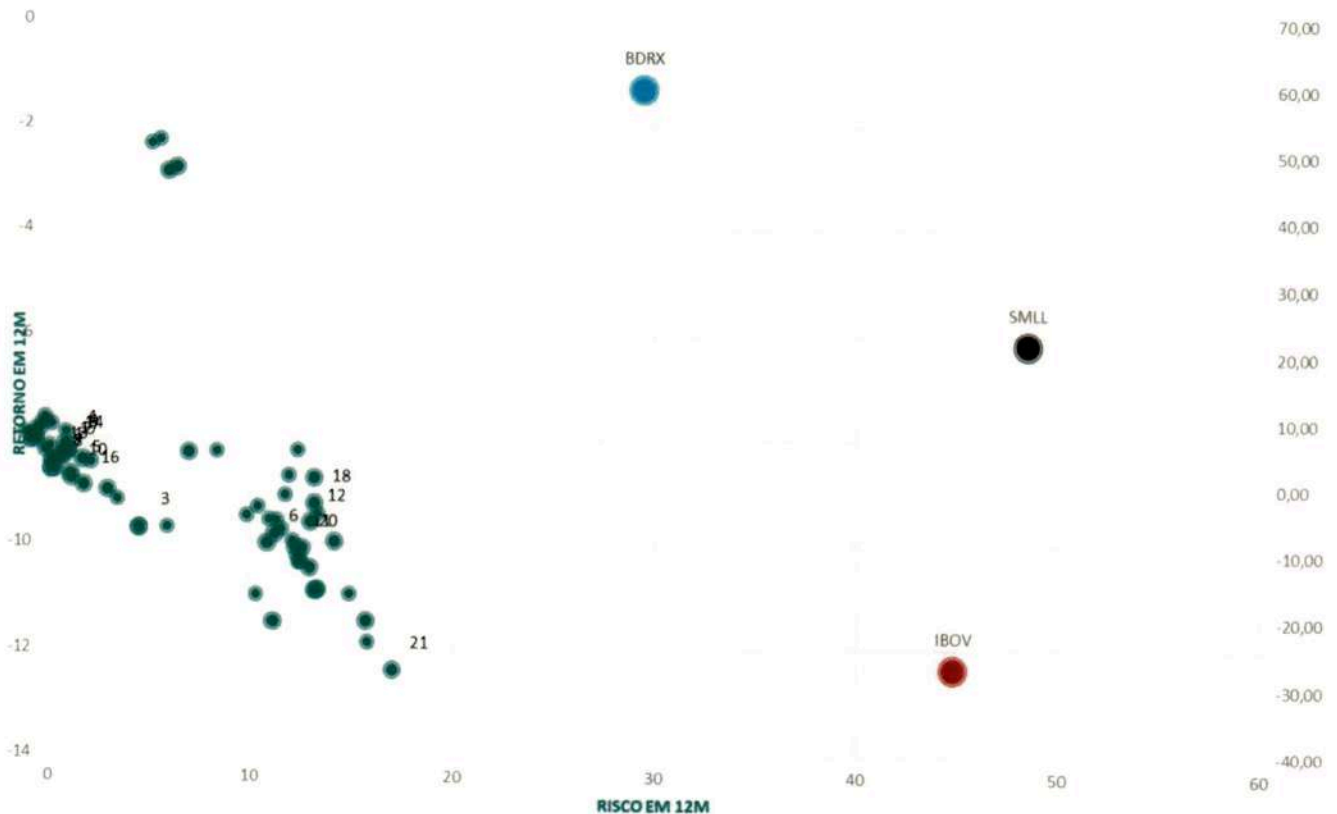


Gráfico 1: Análise Risco x Retorno (12 M)

[Assinaturas manuscritas em azul]

Relatório de Investimentos – Outubro/2020

| Nº | Fundos | Código | Retorno | Volatilidade |
|----|--|---------------|---------|--------------|
| 1 | BB Prev RF Irf M1 Tit Publ Fc | 239003<BraNa> | 3,67 | 0,15 |
| 2 | BB Prev RF Tit Publ VII FI | 390739<BraNa> | 4,54 | 0,62 |
| 3 | BB Prev RF Ima-B5+ Tp FI | 272620<BraNa> | -6,05 | 4,45 |
| 4 | BB Prev RF Idka 2 FI | 272612<BraNa> | 6,32 | 0,83 |
| 5 | BB Prev RF Alocacao Ativa Fcfi | 423041<BraNa> | 1,80 | 1,07 |
| 6 | BB Acoes Valor Fc FIA | 458236<BraNa> | -8,40 | 10,82 |
| 7 | Bradesco FI RF Maxi Poder Publico | 179991<BraNa> | 2,57 | 0,13 |
| 8 | Bradesco FI RF Ref DI Premium | 071171<BraNa> | 2,58 | 0,13 |
| 9 | Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5 | 374131<BraNa> | 5,49 | 0,93 |
| 10 | Bradesco Fc FI RF Alocacao Dinamica | 456306<BraNa> | 1,24 | 1,09 |
| 11 | Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha | 326712<BraNa> | -9,05 | 12,18 |
| 12 | Bradesco FIA Mid Small Caps | 131679<BraNa> | -5,27 | 12,93 |
| 13 | FI Caixa Brasil Irf M 1 Tp RF | 248975<BraNa> | 3,85 | 0,14 |
| 14 | FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP | 251496<BraNa> | 5,38 | 0,92 |
| 15 | Caixa FI Brasil 2020 V Tp RF | 401854<BraNa> | | |
| 16 | Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF | 401862<BraNa> | 0,18 | 1,72 |
| 17 | Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF | 427683<BraNa> | 4,51 | 0,66 |
| 18 | Caixa FIA Consumo | 302198<BraNa> | -2,43 | 13,15 |
| 19 | Itau Instit Alocacao Dinamica RF FICFI | 399892<BraNa> | 3,26 | 0,24 |
| 20 | Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI | 208507<BraNa> | -9,12 | 12,52 |
| 21 | Itau Institucional Acoes Phoenix Fc FI | 424838<BraNa> | -27,31 | 17,03 |
| 22 | Itau Acoes Dunamis Fc | 423701<BraNa> | -12,18 | 12,88 |
| 23 | Small Cap Valuation Fc Acoes | 025127<BraNa> | -8,09 | 14,11 |
| 24 | Santander Selecao 30 Acoes Fc | 464066<BraNa> | -15,42 | 13,25 |
| 25 | Santander FICFI Selecao Top Acoes | 053872<BraNa> | -15,32 | 13,27 |
| 26 | Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes | 055840<BraNa> | -15,46 | 13,15 |
| 27 | Santander RF Ativo Fc FI | 440264<BraNa> | 2,54 | 0,27 |
| 28 | Icatu Vanguarda Dividendos FIA | 173126<BraNa> | -20,24 | 11,11 |
| 29 | Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP | 231932<BraNa> | 5,27 | 0,95 |
| 30 | Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP | 244953<BraNa> | -6,24 | 4,48 |
| 31 | Icatu Vanguarda Acoes Ibx FI | 127558<BraNa> | -10,39 | 12,32 |
| 32 | Safra Ima Institucional Fc FI RF | 478180<BraNa> | -0,55 | 2,90 |
| 33 | BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA | 252311<BraNa> | 1,35 | 13,11 |
| 34 | Safra Consumo Americano FIA Bdr Nivel I | 359130<BraNa> | 47,89 | 6,31 |
| 35 | Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA | 520772<BraNa> | | |
| 36 | Occam Fc de FIA | 378100<BraNa> | -7,06 | 11,19 |
| 37 | Sul America Equities FIA | 255173<BraNa> | -20,07 | 15,68 |
| 38 | Safra S P Reais Pb FI Mult | 401447<BraNa> | 5,21 | 6,94 |
| 39 | Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP | 367354<BraNa> | 4,00 | 1,67 |
| 40 | BB Mult Global Select Equity Ie FI | 349208<BraNa> | 47,29 | 5,87 |
| 41 | BTG Pactual Economia Real FIP | 249688<BraNa> | | |

Quadro 2. Legenda Gráfico 1.

Relatório de Investimentos – Outubro/2020

2. VERIFICAÇÃO DE LASTRO DOS FUNDOS DE RISCO DE CRÉDITO

DATA BASE EM 30.10.20

| TABELA - DURATION & YIELD POR CLASSE | | | |
|--------------------------------------|----------|--------|--------|
| Ativo | Duration | Spread | % PL |
| DEB | 3,32 | 2,20% | 55,4% |
| CRI | 0,00 | 0,00% | 0,0% |
| LF | 2,25 | 1,57% | 10,0% |
| CDB | 0,00 | 0,00% | 0,0% |
| DPGE | 0,00 | 0,00% | 0,0% |
| NP | 1,65 | 2,24% | 1,2% |
| BOND | 0,00 | 0,00% | 0,0% |
| FIDC | 0,00 | 0,00% | 0,0% |
| NTN-B | 4,08 | - | 28,3% |
| Over | 0,00 | - | 5,1% |
| Carteira Crédito | 3,13 | 2,11% | 66,6% |
| Crédito - Contribuição Fundo | 0,94 | 1,40% | 66,6% |
| Fundo (Inclui DAP e NTN-B) | 2,97 | 1,40% | 100,0% |

Quadro 03

| TABELA - RATING EXTERNO* | | |
|--------------------------|-------------|--------|
| Rating | Financeiro | % PL |
| AAA | 157.299.899 | 19,1% |
| AA+ | 115.830.558 | 14,1% |
| AA | 103.226.011 | 12,6% |
| AA- | 77.645.196 | 9,4% |
| A+ | 58.659.836 | 7,1% |
| DPGE | 0 | 0,0% |
| A | 1.691.842 | 0,2% |
| A- | 10.867.562 | 1,3% |
| BBB+ | 0 | 0,0% |
| BBB | 0 | 0,0% |
| BBB- | 7.279.885 | 0,9% |
| BB+ | 0 | 0,0% |
| BB | 0 | 0,0% |
| BB- | 10.324.008 | 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 | 4.836.223 | 0,6% |
| Tesouro / Over | 274.115.074 | 33,4% |
| Total | 821.776.093 | 100,0% |

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

Quadro 04.

| TABELA - SETOR | | |
|------------------------|-------------|--------|
| Setor | Financeiro | % PL |
| Elétrico | 144.403.092 | 17,6% |
| Bancos | 82.478.251 | 10,0% |
| Conc. Rodoviárias | 78.577.205 | 9,6% |
| Saneamento | 66.285.226 | 8,1% |
| Serviço | 57.774.191 | 7,0% |
| Varejo | 39.529.586 | 4,8% |
| Shopping Center | 36.311.880 | 4,4% |
| Óleo e Gás | 12.912.075 | 1,6% |
| Mineração e Siderurgia | 11.441.111 | 1,4% |
| Logística | 8.361.373 | 1,0% |
| Papel e Celulose | 4.029.524 | 0,5% |
| Holding | 3.046.835 | 0,4% |
| Infraestrutura | 2.510.672 | 0,3% |
| Tesouro / Over | 274.115.074 | 33,4% |
| Total | 821.776.093 | 100,0% |

Quadro 05.

Nota: Dados referentes ao fundo ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CREDITO PRIVADO LP. (base: 30/10/2020)


PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 16 de novembro de 2020, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de outubro/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, 16 de novembro 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: