

Relatório de Investimentos – Setembro/2023

Processo: **2023.A.09619**
Destino: **DIRAF / PRESI**
Assunto: **Relatório de Investimentos – setembro/2023**
Data: **17/10/2023**

RELATÓRIO Nº. 037/2023-COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **setembro/2023**, destacando:

- 1) Cenário econômico externo e interno, **fornecido pela LDB CONSULTORIA**, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (**em anexo**);
- 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 03 a 09);
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 10 a 12);
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (páginas 13 a 15);
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (páginas 16 a 18);
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (páginas 19 a 22)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (páginas 23 a 25);
- 8) Rentabilidade do Fundo Previdenciário - Consolidado – FPREV (páginas 26 a 27);
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro – (páginas 28 a 29);
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 30);
- 11) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 31 a 38);
- 12) Total dos Recursos e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (página 39);
- 13) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 40);
- 14) Parecer do Comitê de Investimentos (página 41).



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

2.1. SALDOS E PERFORMANCE RENDA FIXA

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2023	29/09/2023	jul/23	ago/23	set/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BB PREVID IDKA 2	R\$ 390.706.815,26	R\$ 391.533.945,79	0,9433	0,7392	0,2117	1,9047%	3,3439%	NC
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 390.774.705,71	R\$ 391.212.030,81	0,9516	0,5971	0,1119	1,6680%	3,3646%	NC
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ -	R\$ 42.418.223,76	-	-	(0,3000)	-0,3000%	-0,3000%	NC
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 56.231.267,91	R\$ 56.847.357,45	1,0500	0,8900	1,1000	3,0708%	8,5800%	11,5100%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 111.369.516,10	R\$ 111.819.259,61	0,8930	0,6307	0,4038	1,9393%	1,9393%	NC
SAFRA SOBERANO REGIM PROP DI	R\$ 85.752.437,16	R\$ 86.580.177,21	1,0400	1,1300	0,9700	3,1729%	9,7803%	13,2635%
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 308.193,72	R\$ 1.602.910,83	1,0100	1,1000	0,9300	3,0708%	9,4872%	12,8048%
ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 51.795.124,49	R\$ 52.300.117,95	1,0600	1,1400	0,9700	3,2035%	9,8890%	13,3757%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 1.086.938.060,35	R\$ 1.134.314.023,41						
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 144.264.841,78	R\$ 111.223.404,33	1,1800	1,2700	1,0500	3,5409%	8,0652%	NC
CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP	R\$ 11.601.501,41	R\$ 11.720.564,02	1,1411	1,2372	1,0263	3,4433%	10,0872%	13,6701%
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 155.866.343,19	R\$ 122.943.968,35						
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 65.249.383,50	R\$ 35.749.468,90	0,8975	1,6465	1,2112	3,8010%	8,1161%	11,8045%
ITAU HIGH GRADE RF DP FIC FI	R\$ 97.155.975,99	R\$ 98.191.459,42	1,1900	1,3100	1,0700	3,6125%	10,3456%	14,1852%
BTG PACTUAL CRED CORP FIC FI RF CP	R\$ 97.142.565,18	R\$ 98.439.245,28	1,6300	1,9800	1,3300	5,0207%	9,2891%	13,1143%
PORTO SEGURO FI REFER DI CRED PRIV	R\$ 97.800.940,62	R\$ 98.902.239,70	1,3543	1,6117	1,1261	4,1476%	9,9577%	13,6300%
BNP PARIBAS MATCH DI FI RF REF CP	R\$ 103.042.726,92	R\$ 104.086.843,90	1,1344	1,1800	1,0133	3,3647%	10,1581%	13,8202%
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RF CRED PR	R\$ 33.441.491,33	R\$ 64.019.292,92	1,1000	1,1900	1,0600	3,3875%	3,3875%	NC
TOTAL art. 7º, inciso V, "b"	R\$ 493.833.083,54	R\$ 499.388.550,12						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 1.736.637.487,08	R\$ 1.756.646.541,88						

Quadro 1.

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

Nota 2: As movimentações neste mês tiveram como base a **Ata de reunião do COMIV nº. 202/2023**, devidamente aprovada pela Diretoria, através do Despacho de 28/08/2023, constante do processo nº 2023.A.07460: **Item 3.1. FPREV Executivo:**

a) Recursos Novos: Aplicar no Itaú Alocação Dinâmica (21.838.150/0001-49). Na análise dos membros do Comitê, a opção por esse ativo está relacionada a estratégia do fundo, que é de gestão ativa em IMA, com maior alinhamento ao Cenário para a taxa de juros em ciclo de queda. Observa-se que tal produto possui correlação com o índice IMA, essa estratégia de gestão traz ótimo desempenho com menor risco. Dessa forma, a carteira da Amazonprev fica mais equilibrada do ponto de vista de fundos indexados à inflação com gestão ativa; **b3) Demais Recursos:** Migrar R\$ 30 milhões aplicados no fundo Santander Crédito Privado Crescimento (17.138.474/0001-05), pois o mesmo apresenta desenquadramento ao limite de 5% do PL do fundo, para o fundo Safra Extra Bancos (20.441.483/0001-77), assim fica mantida a estratégia de alocação em Crédito Privado, aumentando a posição em ativos que apresentam, nesse momento, alinhamento ao Cenário.



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

2.2 SALDOS E PERFORMANCE RENDA VARIÁVEL

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/08/2023	29/09/2023	jul/23	ago/23	set/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES	
TARPON GT INST I FIC FIA	R\$ 77.760.238,83	R\$ 83.712.757,48	5,9069	(2,1346)	7,6550	11,5803%	39,2887%	32,3378%	
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 73.223.532,46	R\$ 74.324.579,01	5,3187	(3,3498)	1,5037	3,3214%	24,8818%	20,2723%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 99.981.263,45	R\$ 100.240.288,79	3,8244	(5,8143)	0,2590	-1,9590%	2,0216%	-0,0071%	
FUNDOS RENDA VARIÁVEL - AÇÕES VALOR	R\$ 250.965.034,74	R\$ 258.277.625,28							
BRASIL CAPITAL RP INSTIT FIC AÇÕES	R\$ 34.776.895,93	R\$ 34.409.733,87	6,1100	(6,8700)	(1,0600)	-2,2273%	16,2146%	14,8636%	
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 43.215.811,74	R\$ 42.782.398,81	1,4500	(4,8700)	(1,0000)	-4,4557%	6,8625%	1,0233%	
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 102.848.280,07	R\$ 102.817.630,46	3,9000	(4,6200)	(0,0300)	-0,9299%	10,2955%	3,5687%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 37.022.796,07	R\$ 36.916.150,07	3,2800	(5,2200)	(0,2900)	-2,3951%	4,7936%	-0,4544%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 91.051.529,84	R\$ 91.766.557,16	2,8500	(5,7700)	0,7900	-2,3188%	2,1324%	0,5440%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 49.905.253,70	R\$ 49.804.042,99	2,6100	(4,9500)	(0,2000)	-2,6643%	-4,1760%	-1,3032%	
BB AÇÕES SELEÇÃO FATOR FIC FI	R\$ 51.728.605,22	R\$ 51.971.934,92	3,2736	(4,2990)	0,4703	-0,7013%	4,4296%	1,9362%	
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANT	R\$ 13.761.739,71	R\$ 13.745.076,30	1,8985	(3,4032)	(0,1211)	-1,6885%	11,7988%	10,8495%	
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 14.925.334,00	R\$ 14.764.263,00	4,4400	(4,1600)	(1,0800)	-0,9857%	4,6604%	0,5111%	
FUNDOS RENDA VARIÁVEL - AÇÕES LIVRE	R\$ 439.236.246,28	R\$ 438.977.787,58							
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 83.578.311,82	R\$ 84.067.000,93	3,2700	(4,0100)	0,5800	-0,2962%	3,9811%	4,4131%	
TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 5.441.157,73	R\$ 5.726.706,12	1,0800	2,2800	5,2500	8,8123%	20,4928%	26,5971%	
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 66.895.504,45	R\$ 66.834.251,11	3,6100	(5,7800)	(0,0900)	-2,4665%	0,1585%	-1,9797%	
FUNDOS RENDA VARIÁVEL - DIVIDENDOS	R\$ 155.914.974,00	R\$ 156.627.958,16							
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 75.096.168,64	R\$ 74.303.361,76	3,6300	(5,7900)	(1,0600)	-3,4051%	5,6262%	1,8508%	
BRDESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 108.030.379,88	R\$ 105.359.085,41	2,9100	(10,2800)	(2,4700)	-9,9497%	-6,1645%	-11,4529%	
ITAÚ SMALL CAPS VALUATION	R\$ 73.400.955,09	R\$ 71.770.718,05	2,7600	(7,1100)	(2,2200)	-6,6653%	3,7870%	-3,1034%	
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 45.995.975,77	R\$ 47.384.848,42	2,5100	2,4100	3,0200	8,1509%	14,3704%	17,3601%	
FUNDOS RENDA VARIÁVEL - SMALL CAPS	R\$ 302.523.479,38	R\$ 298.818.013,64							
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.547.209,78	R\$ 18.582.849,61	2,7402	(4,8859)	0,1922	-2,0918%	1,2553%	1,0949%	
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 188.483.693,10	R\$ 189.659.027,89	3,0600	(7,1800)	0,6200	-3,7466%	2,0455%	-2,0064%	
FUNDOS RENDA VARIÁVEL - AÇÕES	R\$ 207.030.902,88	R\$ 208.241.877,50							
TOTAL RENDA VARIÁVEL - art. 8º, inciso I	R\$ 1.355.670.637,28	R\$ 1.360.943.262,16							

Quadro 2.

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.

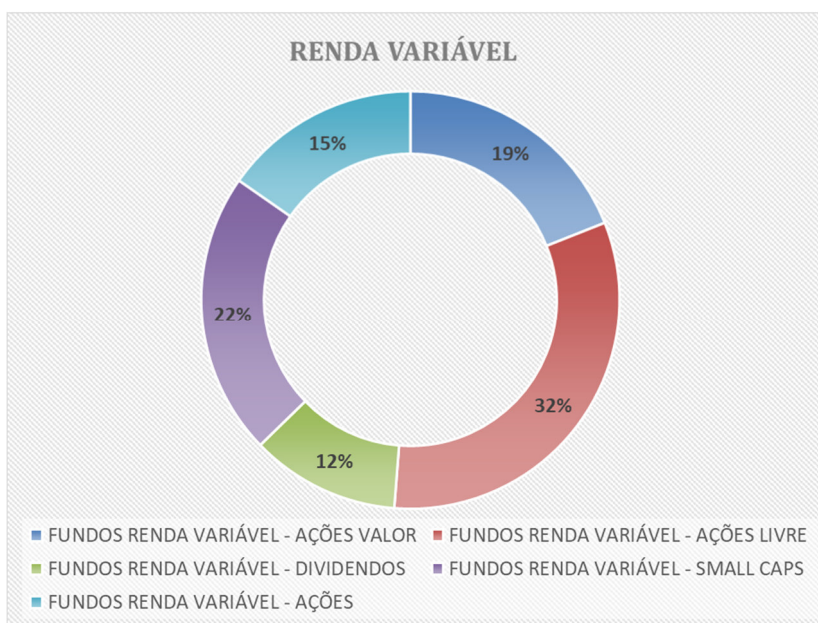


Gráfico 1. Estratégia de Alocação em Fundos de Ações – FPREV Executivo.



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

2.3 SALDOS E PERFORMANCE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/08/2023	29/09/2023	jul/23	ago/23	set/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 34.118.323,80	R\$ 32.942.226,47	0,1527	4,4251	(3,4471)	0,9794%	-1,5284%	5,5174%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 15.553.199,43	R\$ 15.081.471,21	5,4848	(4,4987)	(3,0330)	-2,3161%	18,0706%	2,1658%	
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 47.016.197,90	R\$ 45.704.797,02	1,7742	2,0950	(2,7892)	1,0082%	2,0355%	10,8335%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 26.585.690,73	R\$ 25.798.114,17	1,8100	1,3000	(2,9600)	0,0808%	2,9366%	13,5223%	
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exte	R\$ 123.273.411,86	R\$ 119.526.608,87							
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 64.143.013,05	R\$ 62.035.889,79	2,2021	2,8264	(3,2850)	1,6385%	9,4168%	15,7436%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 29.232.955,32	R\$ 28.415.764,23	1,5500	3,7700	(2,8000)	2,4278%	10,0525%	14,3782%	
ITAU BDR NIVEL I AÇÕES FIC	R\$ 32.125.293,63	R\$ 31.830.889,70	1,9000	2,7200	(0,9200)	3,7087%	3,5446%	10,8216%	
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 125.501.262,00	R\$ 122.282.543,72							
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 248.774.673,86	R\$ 241.809.152,59							

Quadro 3.

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

2.4 SALDOS E PERFORMANCE – FUNDOS ESTRUTURADOS

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/08/2023	29/09/2023	jul/23	ago/23	set/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES	
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 18.528.958,11	R\$ 17.716.168,69	3,6800	(0,8900)	(4,3900)	-1,7538%	15,8518%	27,3894%	
FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV FIM	R\$ 16.081.169,80	R\$ 16.112.432,74	1,1933	(3,2928)	0,1944	-1,9486%	4,2932%	-0,2675%	
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ 19.346.783,74	R\$ 19.475.103,86	4,3664	(2,2423)	0,6633	2,7029%	14,0106%	18,5298%	
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MM	R\$ 16.049.073,68	R\$ 16.109.796,23	1,9900	(2,6900)	0,3800	-0,3764%	5,1105%	6,4170%	
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$ 32.939.464,57	R\$ 33.040.384,39	0,8900	1,0700	0,3100	2,2856%	9,8250%	10,7646%	
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MM	R\$ 10.499.239,27	R\$ 10.532.520,82	0,8400	(0,0500)	0,3200	1,1121%	2,3872%	0,6561%	
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 113.444.689,17	R\$ 112.986.406,73							
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 40.813.196,00	R\$ 40.957.376,01	(0,1700)	(0,2000)	0,8600	0,4872%	16,8792%	16,5172%	
BTG PACTUAL INV DE IMPACTO CL A FIP MULT	R\$ 22.885.503,63	R\$ 22.842.115,97	(0,2100)	(1,1800)	(0,1900)	-1,5749%	9,2168%	6,6800%	
BTG PACTUAL CLA ECONOMIA R II FIP MULT	R\$ 6.890.569,14	R\$ 6.750.844,28	(1,5100)	(2,3900)	(2,0300)	-5,8155%	-10,0721%	-10,0721%	
CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$ 1.595.670,77	R\$ 1.613.231,92	3,4000	0,1900	1,1000	4,7360%	13,9713%	43,0268%	
KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$ 22.724.698,78	R\$ 27.477.002,27	(0,7972)	(0,6526)	2,7371	1,2530%	-4,2208%	-8,8981%	
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP	R\$ -	R\$ 21.638.591,05	-	-	(3,2600)	-3,2600%	-3,2600%	0,0000%	
TOTAL art. 10º, inciso II	R\$ 94.909.638,32	R\$ 121.279.161,50							
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 208.354.327,49	R\$ 234.265.568,23							
TOTAL GERAL	R\$ 3.549.437.125,71	R\$ 3.593.664.524,86							
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -							
TOTAL RECURSOS	R\$ 3.549.437.125,71	R\$ 3.593.664.524,86							

Quadro 4.

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

Nota 2: A aplicação no FIP PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY, teve como base o Parecer nº 074/2023/COMIV, de 17/04/2023, bem como, a Ata de reunião do COMIV nº. 198/2023, devidamente aprovada pela Diretoria, através do Despacho de 10/05/2023, constante do processo nº 2023.A.03295.

Nota 2: Registra-se o 6º aporte no valor de R\$ 4.983.567,55 (quatro milhões, novecentos e oitenta e três mil, quinhentos e sessenta e sete reais e cinquenta e cinco centavos), no fundo FIP KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL MULTI, totalizando até o momento 32,10% do total a ser integralizado.



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

2.5 CONTROLE DE EVOLUÇÃO DOS FIPS

APORTES/FUNDOS	VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP	KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP	BTG ECONOMIA REAL FIP	BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP	BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP	BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA III FEEDER FIP	Pátria PE VII Advisory FIP Multi - Classe C	TOTAL DE RECURSOS
1ª CHAMADA DE CAPITAL	R\$ 268.453,31	R\$ 2.875.000,00	R\$ 5.671.011,85	R\$ 5.840.901,39	R\$ 9.515.813,90	R\$ -	R\$ 23.416.702,50	R\$ 47.587.882,95
2ª CHAMADA DE CAPITAL	R\$ 334.844,05	R\$ 9.278.448,35	R\$ 2.063.666,86	R\$ 1.666.666,72	R\$ 1.702.633,54	R\$ -	R\$ -	R\$ 15.046.259,52
3ª CHAMADA DE CAPITAL	R\$ 264.358,56	R\$ 6.329.310,18	R\$ 3.331.898,77	R\$ -	R\$ 690.979,79	R\$ -	R\$ -	R\$ 10.616.547,30
4ª CHAMADA DE CAPITAL	R\$ 87.385,16	R\$ 1.013.353,25	R\$ 1.325.970,49	R\$ -	R\$ 6.779.214,99	R\$ -	R\$ -	R\$ 9.205.923,89
5ª CHAMADA DE CAPITAL	R\$ 117.214,27	R\$ 8.673.587,50	R\$ 1.579.015,44	R\$ -	R\$ 1.635.358,51	R\$ -	R\$ -	R\$ 12.005.175,72
6ª CHAMADA DE CAPITAL	R\$ 139.146,78	R\$ 4.983.567,55	R\$ 6.028.436,59	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 11.151.150,92
7ª CHAMADA DE CAPITAL	R\$ 153.285,87	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 153.285,87
TOTAL INTEGRALIZADO	R\$ 1.364.688,00	R\$ 33.153.266,83	R\$ 20.000.000,00	R\$ 7.507.568,11	R\$ 20.324.000,73	R\$ -	R\$ 23.416.702,50	R\$ 105.766.226,17
TOTAL SUBSCRITO	R\$ 25.000.000,00	150.000.000,00	R\$ 20.000.000,00	R\$ 100.000.000,00	R\$ 50.000.000,00	R\$ 100.000.000,00	R\$ 150.000.000,00	R\$ 595.000.000,00
TOTAL BASE SET/2023	R\$ 1.613.231,92	R\$ 27.477.002,27	R\$ 40.957.376,01	R\$ 6.750.844,28	R\$ 22.842.115,97	R\$ -	R\$ 21.638.591,05	R\$ 121.279.161,50
ATA/PARECER-COMIV	182/2021 ; Item 5.2	182/2021 ; Item 5.1	Parecer nº 2251/2020	187/2022 ; Item 6.1	Parecer nº 899/2021	Ata nº 198/2023 e Parecer nº 074/2023	Ata nº 198/2023 e Parecer nº 074/2023	
PROCESSO SISPREV	2022.A.00051	2022.A.00051	2021.A.22978	2022.A.03010	2021.A.21245	2023.A.03295	2023.A.03295	
DESPACHO DIRETORIA	07.01.2022	07.01.2022	04.09.2020	25.05.2022	18.05.2021	10.05.2023	10.05.2023	
PERÍODO INVEST /DESINVEST	4 / 6		3 / 4	4 / 4	3 / 4	5 / 5	6 / 4	
RETORNO PREVISTO	IPCA + 16% a.a.		IPCA + 15% a.a.	IPCA + 20% a.a.	20% Bruto a.a.	IPCA + 15% a.a.	35% bruto a.a.	
ADMINISTRADOR	BTG PACTUAL	INTRAG DTVM	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	XP INVEST	
GESTOR	VINCI PARTNERS	KINEA	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	PATRIA INVEST	
TOTAL A INTEGRALIZAR (R\$)	R\$ 23.635.312,00	R\$ 116.846.733,17	R\$ -	R\$ 92.492.431,89	R\$ 29.675.999,27	R\$ 100.000.000,00	R\$ 126.583.297,50	R\$ 489.233.773,83
TOTAL A INTEGRALIZAR (%)	94,54%	77,90%	0,00%	92,49%	59,35%	100,00%	84,39%	82,22%

Quadro 5.

2.6 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

INSTITUIÇÃO	jul/23	ago/23	set/23
BRASESCO	R\$ 212.986.641,28	R\$ 252.603.415,38	R\$ 218.185.400,57
BTG	R\$ 386.275.250,75	R\$ 374.744.485,16	R\$ 376.364.778,12
ITAÚ	R\$ 309.906.819,94	R\$ 304.382.602,90	R\$ 346.315.451,87
BANCO DO BRASIL	R\$ 610.425.320,12	R\$ 606.559.696,98	R\$ 605.782.059,29
CAIXA	R\$ 566.645.825,03	R\$ 619.166.684,38	R\$ 620.931.824,79
ICATU	R\$ 87.067.240,86	R\$ 83.578.311,82	R\$ 84.067.000,93
SANTANDER	R\$ 110.243.872,34	R\$ 112.265.581,40	R\$ 81.454.265,92
PORTO	R\$ 96.249.697,20	R\$ 97.800.940,62	R\$ 98.902.239,70
VINCI	R\$ 148.482.914,25	R\$ 141.466.746,91	R\$ 141.347.012,45
SAFRA	R\$ 146.013.135,79	R\$ 148.426.883,81	R\$ 179.015.234,36
OCCAM	R\$ 96.621.843,99	R\$ 91.051.529,84	R\$ 91.766.557,16
BNP	R\$ 101.840.956,64	R\$ 103.042.726,92	R\$ 104.086.843,90
AZ QUEST	R\$ 79.714.603,53	R\$ 75.096.168,64	R\$ 74.303.361,76
RIO BRAVO	R\$ 59.588.208,70	R\$ 59.487.777,52	R\$ 59.682.701,44
ARX	R\$ 71.000.932,90	R\$ 66.895.504,45	R\$ 66.834.251,11
TARPON	R\$ 79.456.279,80	R\$ 77.760.238,83	R\$ 83.712.757,48
GUEPARDO	R\$ 75.761.420,16	R\$ 73.223.532,46	R\$ 74.324.579,01
TRÍGONO	R\$ 50.231.597,61	R\$ 51.437.133,50	R\$ 53.111.554,54
GENIAL/PLURAL	R\$ 49.042.191,24	R\$ 49.671.523,23	R\$ 48.023.697,68
CONSTANCIA	R\$ 45.427.199,98	R\$ 43.215.811,74	R\$ 42.782.398,81
BRASIL CAPITAL	R\$ 37.311.040,16	R\$ 34.776.895,93	R\$ 34.409.733,87
SCHRODER	R\$ 26.243.585,53	R\$ 26.585.690,73	R\$ 25.798.114,17
DAYCOVAL	R\$ 19.499.959,01	R\$ 18.547.209,78	R\$ 18.582.849,61
INTRAG/KINEA	R\$ 22.873.975,75	R\$ 22.724.698,78	R\$ 27.477.002,27
CLARITAS	R\$ 15.573.589,42	R\$ 14.925.334,00	R\$ 14.764.263,00
PATRIA	R\$ -	R\$ -	R\$ 21.638.591,05
TOTAL	R\$ 3.504.484.101,98	R\$ 3.549.437.125,71	R\$ 3.593.664.524,86

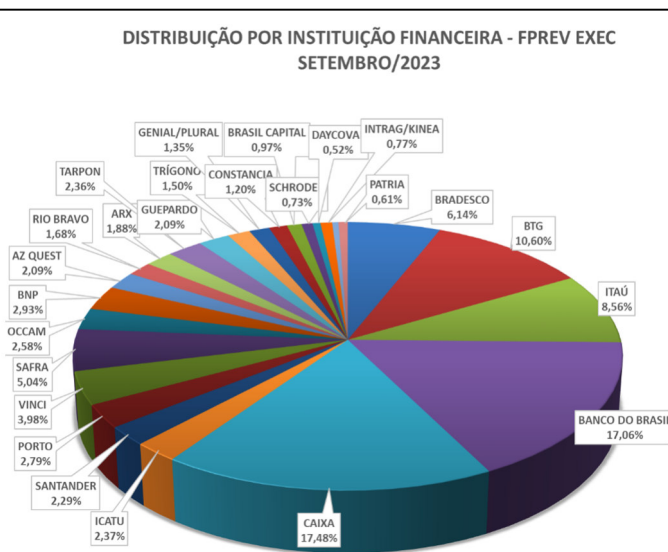


Gráfico 2.

Quadro 6.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 18/10/2023 12:18:10
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/10/2023 11:27:31
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 18/10/2023 08:52:52
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/10/2023 08:55:01
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/10/2023 08:59:59
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 18/10/2023 11:39:09
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 18/10/2023 11:55:31



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

2.7 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

DATA DA LIQUIDAÇÃO	ORIGEM DO RECURSO / ÓRGÃO	VENCIMENTO	VALOR NA COMPRA	PU de compra (R\$)	TAXA %	QUANTIDADE	INSTITUIÇÃO CEDENTE
14/01/2014	EXECUTIVO	15/08/2030	R\$ 99.437.031,23	2.288,5392690	6,5998%	43.450	BANCO BRADESCO
28/01/2014	EXECUTIVO	15/08/2030	R\$ 98.620.663,31	2.235,6371889	6,9000%	44.113	BANCO BRADESCO
14/01/2014	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 99.980.152,45	2.254,3439110	6,6000%	44.350	BANCO BRADESCO
26/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 32.996.277,05	4.035,2546230	5,9080%	8.177	BTG PACTUAL CTVM
26/05/2022	EXECUTIVO	15/05/2025	R\$ 32.996.442,13	3.995,2103320	5,7700%	8.259	ITAU UNIBANCO S/A
26/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2032	R\$ 32.999.881,95	4.101,4021820	5,7600%	8.046	ITAU UNIBANCO S/A
27/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 99.996.790,45	4.042,2342330	5,8400%	24.738	XP INVESTIMENTOS CCTVM
30/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 99.996.581,53	4.045,3328020	5,8300%	24.719	XP INVESTIMENTOS CCTVM
31/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 99.996.708,44	4.032,4505380	6,0200%	24.798	BRADESCO
31/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 60.469.094,79	4.031,2729860	6,0350%	15.000	XP INVESTIMENTOS CCTVM
07/07/2022	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 49.997.001,46	4.077,3936930	6,0348%	12.262	XP INVESTIMENTOS CCTVM
07/07/2022	EXECUTIVO	15/05/2035	R\$ 49.997.851,49	4.023,0006030	6,0300%	12.428	BANCO BRADESCO
18/11/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 99.997.037,06	3.988,7130860	6,7000%	25.070	XP INVESTIMENTOS CCTVM
24/11/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 99.998.464,79	3.977,3472590	7,0100%	25.142	XP INVESTIMENTOS CCTVM
24/11/2022	EXECUTIVO	15/08/2028	R\$ 44.998.285,53	3.983,9119550	6,3100%	11.295	BGC LIQUIDEZ
24/11/2022	EXECUTIVO	15/08/2032	R\$ 44.998.054,42	3.955,8729160	6,3100%	11.375	BGC LIQUIDEZ
15/12/2022	EXECUTIVO	15/08/2032	R\$ 30.000.634,84	3.947,4519530	6,4350%	7.600	BGC LIQUIDEZ
20/12/2022	EXECUTIVO	15/08/2026	R\$ 43.796.819,33	3.997,5191060	6,5830%	3.656	XP INVESTIMENTOS CCTVM
02/01/2023	EXECUTIVO	15/05/2025	R\$ 49.999.402,21	4.002,5137860	6,3300%	12.492	XP INVESTIMENTOS CCTVM
04/01/2023	EXECUTIVO	15/08/2026	R\$ 49.998.898,46	4.042,6017520	6,3700%	12.368	BANCO BRADESCO
02/02/2023	EXECUTIVO	15/08/2032	R\$ 49.999.079,97	4.050,1482360	6,3230%	12.345	XP INVESTIMENTOS CCTVM
02/02/2023	EXECUTIVO	15/05/2033	R\$ 50.001.797,93	3.967,7668570	6,3890%	12.602	BGC LIQUIDEZ
07/02/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 99.998.414,72	3.945,3331780	6,4990%	25.346	BGC LIQUIDEZ
10/02/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 50.000.319,67	3.989,4933110	6,4000%	12.533	BGC LIQUIDEZ
10/02/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 49.996.382,76	3.992,6834980	6,3920%	12.522	BRADESCO
13/02/2023	EXECUTIVO	15/05/2035	R\$ 49.996.084,50	3.970,4641440	6,3800%	12.592	XP INVESTIMENTOS CCTVM
27/02/2023	EXECUTIVO	15/05/2033	R\$ 49.999.200,55	4.029,5938550	6,2900%	12.408	XP INVESTIMENTOS CCTVM
27/02/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 49.998.484,59	3.900,3420380	6,3800%	12.819	BTG PACTUAL CTVM
28/02/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 45.001.168,51	3.914,5066550	6,3500%	11.496	BTG PACTUAL CTVM
01/03/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 49.998.152,56	3.876,7273440	6,4510%	12.897	BTG PACTUAL CTVM
03/03/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 33.278.800,15	3.870,0663039	6,4810%	8.599	BTG PACTUAL CTVM
28/03/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 80.401.529,70	4.032,7797410	6,1900%	19.937	BGC LIQUIDEZ
29/03/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 24.998.990,87	4.025,6023950	6,2130%	6.210	BTG PACTUAL CTVM
29/03/2023	EXECUTIVO	15/05/2035	R\$ 15.002.435,16	4.134,0411010	6,1230%	3.629	BTG PACTUAL CTVM
30/03/2023	EXECUTIVO	15/05/2035	R\$ 25.002.106,94	4.140,7928030	6,1100%	6.038	XP INVESTIMENTOS CCTVM
30/03/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 15.005.470,96	4.047,8745510	6,1650%	3.707	XP INVESTIMENTOS CCTVM
31/03/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 20.000.649,11	4.035,6434850	6,2001%	4.956	XP INVESTIMENTOS CCTVM
31/03/2023	EXECUTIVO	15/05/2035	R\$ 10.078.203,03	4.135,4957040	6,1330%	2.437	XP INVESTIMENTOS CCTVM
20/04/2023	EXECUTIVO	15/05/2045	R\$ 80.001.923,16	4.159,1849840	6,1076%	19.235	BGC LIQUIDEZ
24/04/2023	EXECUTIVO	15/05/2045	R\$ 19.990.851,03	4.164,7606320	6,1005%	4.800	BGC LIQUIDEZ
15/05/2023	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 14.166.225,80	4.131,2993880	6,9900%	3.429	BRADESCO
15/05/2023	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 66.001.441,62	4.131,2870320	6,9902%	15.976	BGC LIQUIDEZ
18/05/2023	EXECUTIVO	15/05/2025	R\$ 84.534.868,51	4.121,0387810	6,0530%	20.513	BGC LIQUIDEZ
19/05/2023	EXECUTIVO	15/05/2025	R\$ 76.731.768,52	4.110,9975100	6,2150%	18.665	BGC LIQUIDEZ
24/05/2023	EXECUTIVO	15/05/2025	R\$ 17.682.335,73	4.112,1711020	6,2770%	4.300	BGC LIQUIDEZ
24/11/2022	EXECUTIVO - LTN	01/01/2025	R\$ 10.005.811,97	758,0160580	14,0800%	13.200	BGC LIQUIDEZ
TOTAL			R\$ 2.459.144.570,95			1.191.348	

Quadro 7.

Nota: Dados referentes as operações de Compra de Títulos Públicos realizadas desde 2014 com a descrição do ativo, valor do ativo na compra, quantidade de papéis adquiridos e instituição financeira contraparte. A custódia é realizada pela Instituição XP Investimentos que emite Relatório com a Posição Atualizada dos Títulos (anexos).

2.7 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	31/08/2023	29/09/2023
CVS - A	R\$ 720.370,35	R\$ 703.169,57
CVS - B	R\$ 4.660.791,65	R\$ 4.549.529,10
CVS - C	R\$ 93.447,90	R\$ 91.216,58
CVS - D	R\$ 511.117,86	R\$ 498.916,44
TOTAL	R\$ 6.122.026,18	R\$ 5.842.831,69

Quadro 8.

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 – Setembro/2023

2.8 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/23	R\$ 20.548,63	R\$ 147.749,14	R\$ 168.297,77
fev/23	R\$ 20.137,49	R\$ 147.891,88	R\$ 168.029,37
mar/23	R\$ 19.756,14	R\$ 148.193,21	R\$ 167.949,35
abr/23	R\$ 19.342,87	R\$ 148.335,95	R\$ 167.678,82
mai/23	R\$ 18.953,86	R\$ 148.637,28	R\$ 167.591,14
jun/23	R\$ 18.556,69	R\$ 148.922,76	R\$ 167.479,45
jul/23	R\$ 18.154,01	R\$ 149.208,24	R\$ 167.362,25
ago/23	R\$ 17.760,31	R\$ 149.509,57	R\$ 167.269,88
set/23	R\$ 17.347,06	R\$ 149.652,31	R\$ 166.999,37
TOTAL	R\$ 170.557,06	R\$ 1.338.100,34	R\$ 1.508.657,40

Quadro 9.

2.9 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2023				
MÊS	UEA	SEAS	TOTAL	
jan/23	R\$ -	R\$ -	R\$ -	
fev/23	R\$ -	R\$ 200.728,73	R\$ 200.728,73	
mar/23	R\$ 87.271,44	R\$ 100.364,40	R\$ 187.635,84	
abr/23	R\$ 43.635,72	R\$ 100.364,40	R\$ 144.000,12	
mai/23	R\$ -	R\$ -	R\$ -	
jun/23	R\$ 87.271,44	R\$ -	R\$ 87.271,44	
jul/22	R\$ -	R\$ -	R\$ -	
ago/22	R\$ 43.635,72	R\$ 200.728,80	R\$ 244.364,52	
set/22	R\$ -	R\$ -	R\$ -	
TOTAL	R\$ 261.814,32	R\$ 602.186,33	R\$ 864.000,65	

Quadro 10.

2.10 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	31/08/2023	29/09/2023	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 3.549.437.125,71	R\$ 3.593.664.524,86	56,0203%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.729.696.801,49	R\$ 2.749.936.225,22	42,8678%
TÍTULOS CVS	R\$ 5.985.727,76	R\$ 5.842.831,69	0,0911%
IMÓVEIS	R\$ 65.484.778,63	R\$ 65.484.778,63	1,0208%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -	0,0000%
TOTAL	R\$ 6.350.604.433,59	R\$ 6.414.928.360,40	100,00%

Quadro 11.

Nota: Os valores para os Títulos Públicos são atualizados com base em Relatório com a Posição Atualizada dos Títulos.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 18/10/2023 12:18:10
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/10/2023 11:27:31

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 18/10/2023 08:52:52
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/10/2023 08:55:01
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/10/2023 08:59:59
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 18/10/2023 11:39:09
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 18/10/2023 11:55:31

Documento assinado eletronicamente 391220/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MzxxMjIw



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

2.11 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
set/22	R\$ 5.511.466.216,21	0,57%	7,25%	10,53%
out/22	R\$ 5.705.500.023,14	3,52%	11,02%	15,76%
nov/22	R\$ 5.675.963.312,47	-0,52%	10,45%	14,00%
dez/22	R\$ 5.780.297.494,50	1,84%	12,48%	12,48%
jan/23	R\$ 5.771.604.745,47	-0,15%	-0,15%	12,56%
fev/23	R\$ 5.742.296.217,39	-0,51%	-0,66%	10,78%
mar/23	R\$ 5.791.959.003,03	0,86%	0,20%	8,86%
abr/23	R\$ 5.880.428.580,01	1,53%	1,73%	12,49%
mai/23	R\$ 6.042.794.420,25	2,76%	4,54%	14,26%
jun/23	R\$ 6.221.758.620,80	2,96%	7,64%	19,64%
jul/23	R\$ 6.349.177.301,02	2,05%	9,84%	18,78%
ago/23	R\$ 6.350.604.433,59	0,02%	9,87%	15,88%
set/23	R\$ 6.414.928.360,40	1,01%	10,98%	16,39%

Quadro 12.

2.12 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

1. Investimentos - Executivo

Saldo dos Investimentos em 09/2022		R\$ 5.511.466.216,21		
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)	
10/2022	R\$ 47.905.531,55	R\$ 10.820.436,66	R\$ 37.085.094,89	
11/2022	R\$ 47.465.381,12	R\$ 11.535.636,72	R\$ 35.929.744,40	
12/2022	R\$ 110.680.756,99	R\$ 16.540.401,56	R\$ 94.140.355,43	
01/2023	R\$ 33.677.075,44	R\$ 13.128.151,27	R\$ 20.548.924,17	
02/2023	R\$ 48.396.223,00	R\$ 19.336.309,60	R\$ 29.059.913,40	
03/2023	R\$ 47.844.489,27	R\$ 13.501.061,49	R\$ 34.343.427,78	
04/2023	R\$ 48.529.359,82	R\$ 12.897.196,53	R\$ 35.632.163,29	
05/2023	R\$ 49.523.530,80	R\$ 17.943.389,07	R\$ 31.580.141,73	
06/2023	R\$ 48.501.155,60	R\$ 14.660.037,39	R\$ 33.841.118,21	
07/2023	R\$ 54.934.340,93	R\$ 13.180.680,80	R\$ 41.753.660,13	
08/2023	R\$ 51.193.351,70	R\$ 14.114.289,57	R\$ 37.079.062,13	
09/2023	R\$ 51.455.681,82	R\$ 13.840.342,71	R\$ 37.615.339,11	
Saldo dos Investimentos em 09/2023		R\$ 6.414.928.360,40		

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %		Índice de Inflação	IPCA (IBGE)	
Item	Em 12 meses	No ano	No mês		
IPCA (IBGE)	5,1852 %	3,4996 %	0,2600 %		
Juros	5,1200 %	3,8159 %	0,4170 %		
Meta	10,5707 %	7,4491 %	0,6781 %		
Rentabilidade em %	7,5825 %	5,6459 %	0,4206 %		
Rentabilidade em R\$	R\$ 434.853.199,52	R\$ 333.177.115,95	R\$ 26.708.587,70		
Resultado em %	-2,7025 %	-1,6782 %	-0,2558 %		
Resultado em R\$	R\$ -171.258.518,31	R\$ -106.377.343,41	R\$ -16.351.946,40		

Quadro 13.

Nota 1: Os valores de **Receita** referem-se às contribuições previdenciárias recebidas no período. Os valores de **Despesas** referem-se aos valores pagos de previdência e taxa de administração do Executivo FPREV, registrados sob Regime de Caixa.



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO- FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO						
	31/08/2023	29/09/2023	jul23	ago23	set23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 627.085,78	R\$ 629.618,15	0,8930	0,6307	0,4038	1,9393%	1,9393%	1,9393%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 75.602,71	R\$ 288.481,71	0,9000	0,3700	(0,3000)	0,9695%	11,3370%	10,7486%	
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 702.688,49	R\$ 918.099,86							
SAFRA SOBERANO RP DI FIC REF	R\$ 61.913,64	R\$ 62.511,27	1,0400	1,1300	0,9700	3,1729%	8,5751%	12,0201%	
BRANCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 435.575,94	R\$ 428.008,35	1,0100	1,1000	0,9300	3,0708%	6,4556%	NC	
ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 3.933,84	R\$ 3.972,19	1,0600	1,1400	0,9700	3,2035%	5,5074%	NC	
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 501.423,42	R\$ 494.491,81							
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 1.131.197,99	R\$ 1.146.297,46	1,6300	1,9800	1,3300	5,0207%	9,2891%	13,1143%	
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 1.131.197,99	R\$ 1.146.297,46							
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 2.335.309,90	R\$ 2.558.889,13							

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO						
	31/08/2023	29/09/2023	jul23	ago23	set23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 481.145,37	R\$ 483.958,66	3,2700	(4,0100)	0,5800	-0,2962%	3,9811%	4,4131%	
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 1.067.561,68	R\$ 1.074.218,72	3,0600	(7,1800)	0,6200	-3,7466%	2,0455%	-2,0064%	
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT	R\$ 549.025,04	R\$ 548.360,25	1,8985	(3,4032)	(0,1211)	-1,6885%	11,7988%	10,8495%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 955.135,40	R\$ 962.636,08	2,8500	(5,7700)	0,7900	-2,3188%	2,1324%	0,5440%	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 120.156,70	R\$ 118.888,13	6,1100	(6,8700)	(1,0600)	-2,2273%	16,2146%	14,8636%	
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 3.173.024,19	R\$ 3.188.061,84							
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 3.173.024,19	R\$ 3.188.061,84							

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO						
	31/08/2023	29/09/2023	jul23	ago23	set23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 1.042.810,88	R\$ 1.013.659,68	1,5500	3,7700	(2,8000)	2,4278%	10,0520%	14,3778%	
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 1.042.810,88	R\$ 1.013.659,68							
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.042.810,88	R\$ 1.013.659,68							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/08/2023	29/09/2023	jul23	ago23	set23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES	
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 512.029,77	R\$ 489.476,24	3,5900	(0,9600)	(4,4000)	-1,9187%	17,5262%	28,7229%	
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 512.029,77	R\$ 489.476,24							
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 512.029,77	R\$ 489.476,24							
TOTAL GERAL	R\$ 7.063.174,74	R\$ 7.250.086,89							
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -							
TOTAL DOS RECURSOS	R\$ 7.063.174,74	R\$ 7.250.086,89							

Quadro 14.

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

Nota 2: As movimentações neste mês tiveram como base as **Ata de reunião do COMIV nº. 202/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria, através do Despacho de 28/08/2023, constante do processo nº 2023.A.07460: **Item 3.2. FPREV ALE: a) Recursos Novos:** Aplicar no Itaú Alocação Dinâmica (21.838.150/0001-49), considerando o exposto no item 3.1.



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

3.2 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

DATA DA LIQUIDAÇÃO	ORIGEM DO RECURSO/ÓRGÃO	VENCIMENTO	VALOR NA COMPRA	PU de compra (R\$)	TAXA %	QUANTIDADE	INSTITUIÇÃO CEDENTE
29/01/2014	ASSEMBLEIA	15/08/2030	R\$ 1.357.103,79	2.288.5392690	6,5998%	593	BANCO BRADESCO
12/07/2022	ASSEMBLEIA	15/05/2035	R\$ 5.499.958,54	3.946.4559030	6,2700%	1.394	BTG PACTUAL CTVM
20/12/2022	ASSEMBLEIA	15/08/2026	R\$ 1.199.255,73	3.997.5191060	6,5830%	300	XP INVESTIMENTOS CCTVM
28/02/2023	ASSEMBLEIA	15/05/2033	R\$ 3.000.163,99	4.043.3477691	6,2500%	742	BTG PACTUAL CTVM
28/03/2023	ASSEMBLEIA	15/08/2040	R\$ 2.601.142,93	4.032.7797410	6,1900%	645	BGC LIQUIDEZ
24/04/2023	ASSEMBLEIA	15/05/2045	R\$ 495.606,52	4.164.7606320	6,1005%	119	BGC LIQUIDEZ
18/05/2023	ASSEMBLEIA	15/05/2025	R\$ 271.988,55	4.121.0387810	6,0530%	66	BGC LIQUIDEZ
19/05/2023	ASSEMBLEIA	15/05/2025	R\$ 295.991,82	4.110.9975100	6,2150%	72	BGC LIQUIDEZ
TOTAL			R\$ 14.721.211,86			3.931	

Quadro 15.

Nota: Dados referentes as operações de Compra de Títulos Públicos realizadas desde 2014 com a descrição do ativo, Valor do ativo na compra, quantidade de papéis adquiridos e instituição financeira contraparte. A custódia é realizada pela Instituição XP Investimentos que emite Relatório com a Posição Atualizada dos Títulos.

3.3 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	31/08/2023	29/09/2023
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 2.335.309,90	R\$ 2.558.889,13
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 3.173.024,19	R\$ 3.188.061,84
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.042.810,88	R\$ 1.013.659,68
FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 512.029,77	R\$ 489.476,24
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 16.137.032,76	R\$ 16.255.905,99
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 23.200.207,50	R\$ 23.505.992,88

Quadro 16.

3.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

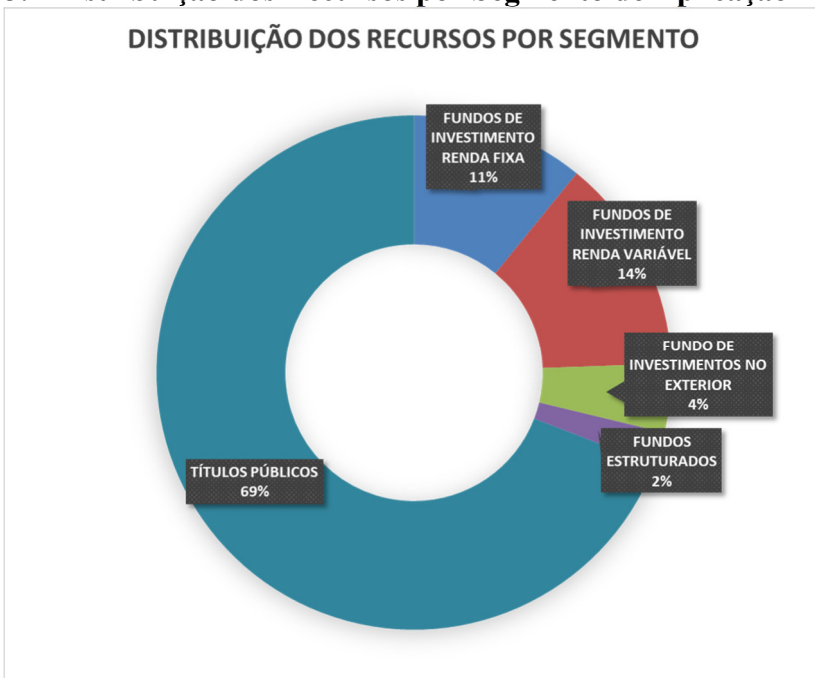


Gráfico 3.



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

3.5 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

1. Investimentos - Assembléia

Saldo dos Investimentos em 09/2022		R\$ 19.289.262,30	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
10/2022	R\$ 209.483,44	R\$ 0,00	R\$ 209.483,44
11/2022	R\$ 208.368,70	R\$ 0,00	R\$ 208.368,70
12/2022	R\$ 215.348,54	R\$ 0,00	R\$ 215.348,54
01/2023	R\$ 415.713,96	R\$ 50.378,58	R\$ 365.335,38
02/2023	R\$ 206.662,34	R\$ 10.022,51	R\$ 196.639,83
03/2023	R\$ 205.889,22	R\$ 10.391,50	R\$ 195.497,72
04/2023	R\$ 206.002,88	R\$ 12.482,71	R\$ 193.520,17
05/2023	R\$ 228.539,50	R\$ 11.441,00	R\$ 217.098,50
06/2023	R\$ 217.377,92	R\$ 11.524,07	R\$ 205.853,85
07/2023	R\$ 217.377,92	R\$ 10.805,73	R\$ 206.572,19
08/2023	R\$ 216.019,28	R\$ 11.691,42	R\$ 204.327,86
09/2023	R\$ 214.375,56	R\$ 11.596,40	R\$ 202.779,16
Saldo dos Investimentos em 09/2023		R\$ 23.505.992,88	

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %		Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês	
IPCA (IBGE)	5,1852 %	3,4996 %	0,2600 %	
Juros	5,1200 %	3,8159 %	0,4170 %	
Meta	10,5707 %	7,4491 %	0,6781 %	
Rentabilidade em %	7,7804 %	6,0297 %	0,4440 %	
Rentabilidade em R\$	R\$ 1.595.905,24	R\$ 1.277.156,73	R\$ 103.006,22	
Resultado em %	-2,5235 %	-1,3210 %	-0,2325 %	
Resultado em R\$	R\$ -571.746,50	R\$ -300.490,06	R\$ -54.303,74	

Quadro 17.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 18/10/2023 12:18:10
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/10/2023 11:27:31

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 18/10/2023 08:52:52
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/10/2023 08:55:01
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/10/2023 08:59:59
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 18/10/2023 11:39:09
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 18/10/2023 11:55:31

Documento assinado eletronicamente 391220/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MzxxMjW



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

4.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos

FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/08/2023	29/09/2023	jul/23	ago/23	set/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 3.610.785,66	R\$ 5.421.380,88	0,8930	0,6307	0,4038	1,5293%	1,9393%	NC	
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 4.655.289,20	R\$ 4.629.631,32	1,0100	1,1000	1,0500	3,1832%	4,2666%	NC	
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 8.266.074,86	R\$ 10.051.012,20							
BRANCO RF DI PREMIUM	R\$ 4.187.875,46	R\$ 4.151.617,75	1,0100	1,2700	1,0500	3,3567%	5,5803%	NC	
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 4.187.875,46	R\$ 4.151.617,75							
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 12.453.950,32	R\$ 14.202.629,95							
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/08/2023	29/09/2023	jul/23	ago/23	set/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.417.889,35	R\$ 1.402.919,78	6,1100	(6,8700)	(1,0600)	10,0759%	16,2146%	14,8636%	
BB AÇÕES VALOR	R\$ 15.323.575,47	R\$ 15.363.274,85	3,8244	(5,8143)	0,2590	5,7843%	2,0215%	-0,0071%	
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 8.463.410,56	R\$ 8.590.673,05	5,3187	(3,5500)	1,5037	11,2888%	24,5257%	19,9293%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 6.109.584,93	R\$ 6.157.563,48	2,8500	(5,7700)	0,7900	6,7525%	2,1324%	-2,1416%	
TARPON GT INST FIC FIA	R\$ 8.802.172,38	R\$ 9.475.975,54	5,9069	(2,1346)	7,6550	14,1402%	39,2887%	32,3378%	
TRIGONO FLAGSHIP INST FI FIA	R\$ 6.517.350,59	R\$ 6.714.145,41	2,5100	2,4100	3,0200	9,0012%	14,3704%	17,3601%	
TOTAL art. 8º, inciso I - RENDA VARIÁVEL	R\$ 46.633.983,28	R\$ 47.704.552,11							
FUNDO DE INVESTIMENTO - FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/08/2023	29/09/2023	jul/23	ago/23	set/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES	
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 8.168.431,87	R\$ 7.808.634,63	3,5900	(0,9600)	(4,4000)	9,6951%	17,5262%	28,7229%	
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 8.168.431,87	R\$ 7.808.634,63							
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 4.157,76	R\$ -							
TOTAL RECURSOS	R\$ 67.260.523,23	R\$ 69.715.816,69							

Quadro 18.

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

Nota 2: As movimentações neste mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. 202/2023, devidamente autorizada pela Diretoria, através do Despacho de 28.08.2023, constante do processo nº 2023.A.07460, **3.3 OUTROS PODERES: MPE / DPE / TJA / TCE FPREV.** a) **Novos Recursos:** Aplicar no fundo Caixa BRASIL FIC Gestão Estratégica RF, mantido o entendimento pela estratégia de gestão ativa com menor volatilidade para o momento; b) **Recursos atuais TJ/AM:** Migrar os recursos aplicados no fundo Maxi Poder Público para o fundo Bradesco DI Premium. Nesse caso, foi considerado a possibilidade de desenquadramento do fundo Maxi, já comentado anteriormente, ainda, não é descartada a possibilidade de aquisição de NTN B, desde que supere a meta atuarial.



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

4.2 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

DATA DA LIQUIDAÇÃO	ORIGEM DO RECURSO / ÓRGÃO	VENCIMENTO	VALOR NA COMPRA	PU de compra (R\$)	TAXA %	QUANTIDADE	INSTITUIÇÃO CEDENTE
09/06/2022	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/08/2024	R\$ 49.999.161,74	4.059,0324520	5,8090%	12.318	SANTANDER
12/07/2022	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/05/2035	R\$ 19.999.849,23	3.946,4559030	6,2700%	5.068	BTG PACTUAL CTVM
13/12/2022	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/05/2025	R\$ 12.000.000,00	3.970,9698140	6,3925%	3.022	XP INVESTIMENTOS CCTVM
15/12/2022	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/08/2028	R\$ 19.997.391,52	3.982,7507510	6,4600%	5.021	BGC LIQUIDEZ
04/01/2023	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/08/2026	R\$ 49.998.898,47	4.042,6017520	6,3700%	12.368	XP INVESTIMENTOS CCTVM
28/02/2023	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/05/2033	R\$ 12.000.655,95	4.043,3477691	6,2500%	2.968	BTG PACTUAL CTVM
03/03/2023	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/08/2040	R\$ 16.718.686,43	3.870,0663039	6,4810%	4.320	BTG PACTUAL CTVM
24/04/2023	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/05/2045	R\$ 3.519.222,73	4.164,7606320	6,1005%	845	BGC LIQUIDEZ
18/05/2023	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/05/2025	R\$ 1.442.363,57	4.121,0387810	6,0530%	350	BGC LIQUIDEZ
19/05/2023	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/05/2025	R\$ 2.996.917,18	4.110,9975100	6,2150%	729	BGC LIQUIDEZ
TOTAL			R\$ 188.673.146,82			47.009	

Quadro 19.

Nota: Dados referentes as operações de Compra de Títulos Públicos realizadas desde 2014 com a descrição do ativo, Valor do ativo na compra, quantidade de papéis adquiridos e instituição financeira contraparte. A custódia é realizada pela Instituição XP Investimentos que emite Relatório com a Posição Atualizada dos Títulos.

4.3 Total dos Recursos – MPE/FPREV

RECURSOS TJ/AM FPREV	SALDO	
	31/08/2023	29/09/2023
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 12.453.950,32	R\$ 14.202.629,95
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 46.633.983,28	R\$ 47.704.552,11
FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 8.168.431,87	R\$ 7.808.634,63
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 193.425.729,49	R\$ 194.835.802,09
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 4.157,76	R\$ -
TOTAL	R\$ 260.686.252,72	R\$ 264.551.618,78

Quadro 20.

Nota: Os valores para os Títulos Públicos são atualizados com base em Relatório com a Posição Atualizada dos Títulos.

4.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

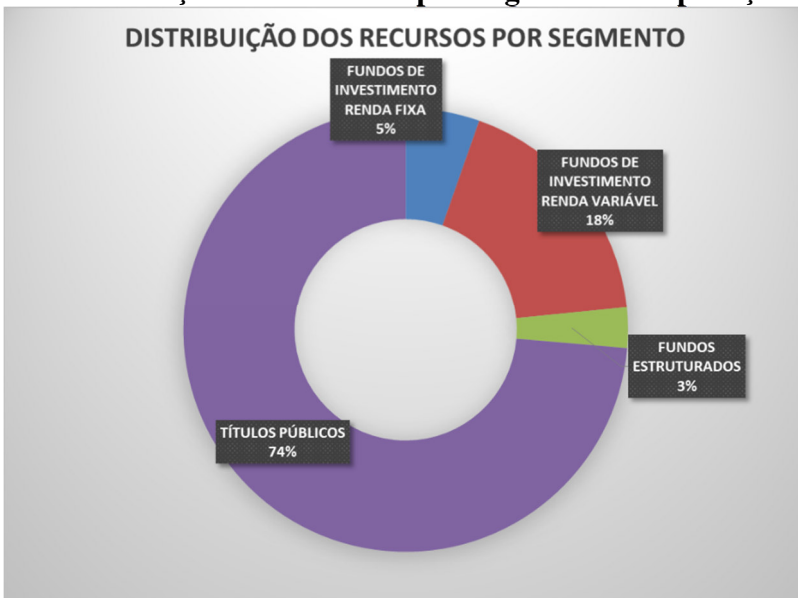


Gráfico 4.



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

4.5 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

1. Investimentos - Ministério Público

Saldo dos Investimentos em 09/2022		R\$ 216.056.215,08	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
10/2022	R\$ 1.621.262,66	R\$ 46.725,64	R\$ 1.574.537,02
11/2022	R\$ 1.613.014,95	R\$ 45.605,84	R\$ 1.567.409,11
12/2022	R\$ 1.611.566,90	R\$ 89.462,79	R\$ 1.522.104,11
01/2023	R\$ 3.260.425,74	R\$ 136.113,27	R\$ 3.124.312,47
02/2023	R\$ 1.613.129,15	R\$ 145.358,74	R\$ 1.467.770,41
03/2023	R\$ 1.623.976,36	R\$ 160.693,65	R\$ 1.463.282,71
04/2023	R\$ 2.424.596,60	R\$ 178.605,05	R\$ 2.245.991,55
05/2023	R\$ 2.448.819,76	R\$ 170.907,83	R\$ 2.277.911,93
06/2023	R\$ 2.450.779,10	R\$ 152.787,06	R\$ 2.297.992,04
07/2023	R\$ 1.803.152,02	R\$ 144.209,32	R\$ 1.658.942,70
08/2023	R\$ 1.789.593,08	R\$ 190.978,30	R\$ 1.598.614,78
09/2023	R\$ 1.799.649,08	R\$ 156.703,67	R\$ 1.642.945,41
Saldo dos Investimentos em 09/2023		R\$ 264.551.618,78	

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %		Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês	
IPCA (IBGE)	5,1852 %	3,4996 %	0,2600 %	
Juros	5,1200 %	3,8159 %	0,4170 %	
Meta	10,5707 %	7,4491 %	0,6781 %	
Rentabilidade em %	11,5238 %	9,3714 %	0,8525 %	
Rentabilidade em R\$	R\$ 26.053.589,46	R\$ 21.858.674,55	R\$ 2.222.420,65	
Resultado em %	+0,8619 %	+1,7890 %	+0,1733 %	
Resultado em R\$	R\$ +2.152.909,29	R\$ +4.481.786,44	R\$ +454.826,81	

Quadro 21.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 18/10/2023 12:18:10
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/10/2023 11:27:31

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 18/10/2023 08:52:52
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/10/2023 08:55:01
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/10/2023 08:59:59
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 18/10/2023 11:39:09
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 18/10/2023 11:55:31

Documento assinado eletronicamente 391220/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MzxxMjIw



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2023	29/09/2023	jul/23	ago/23	set/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGIA	R\$ 2.831.489,90	R\$ 4.176.312,39	-	0,6307	0,4038	1,0370%	1,0370%	NC
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 2.831.489,90	R\$ 4.176.312,39						
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ -	R\$ 3.331.143,07	-	-	1,0500	2,0199%	2,0199%	5,4237%
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 3.415.514,45	R\$ -	1,0100	1,1000	0,9300	3,0708%	7,3513%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 3.415.514,45	R\$ 3.331.143,07						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 6.247.004,35	R\$ 7.507.455,46						
FUNDOS DE AÇÕES	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2023	29/09/2023	jul/23	ago/23	set/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 953.400,34	R\$ 943.334,69	6,1100	(6,8700)	(1,0600)	-2,2273%	16,2146%	14,8636%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 16.907,46	R\$ 16.886,99	1,8985	(3,4032)	(0,1211)	-1,6885%	11,7988%	10,8495%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 3.414.899,05	R\$ 3.466.248,16	5,3187	(3,3498)	1,5037	3,3214%	24,5253%	19,9290%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 4.385.206,85	R\$ 4.426.469,84						
FUNDO ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2023	29/09/2023	jul/23	ago/23	set/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 4.073.813,63	R\$ 3.894.373,20	3,5900	(0,9600)	(4,4000)	-1,9187%	17,5262%	28,7229%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 4.073.813,63	R\$ 3.894.373,20						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 17.170,72						
TOTAL RECURSOS	R\$ 14.706.024,83	R\$ 15.845.469,22						

Quadro 22.

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

Nota 2: As movimentações neste mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. **202/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria, através do Despacho de 28/08/2023, constante do processo nº 2023.A.07460. **3.3 OUTROS PODERES: MPE / DPE / TJA / TCE FPREV. a) Novos Recursos:** Aplicar no fundo Caixa BRASIL FIC Gestão Estratégica RF, nesse caso, mantido o entendimento pela estratégia de gestão ativa com menor volatilidade para o momento.

Nota 3: Resgate do Fundo Maxi Poder Público e Aplicação no Fundo DI Premio, em conformidade com e-mail enviado ao banco Bradesco, pelo financeiro, no dia 15.09.2023.

5.2 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

DATA DA LIQUIDAÇÃO	ORIGEM DO RECURSO / ÓRGÃO	VENCIMENTO	VALOR NA COMPRA	PU de compra (R\$)	TAXA %	QUANTIDADE	INSTITUIÇÃO CEDENTE
12/07/2022	DEFENSORIA PÚBLICA	15/05/2035	R\$ 9.999.924,61	3.946,4559030	6,2700%	2.534	BTG PACTUAL CTVM
13/12/2022	DEFENSORIA PÚBLICA	15/05/2025	R\$ 35.000.000,00	3.970,9698140	6,3925%	8.814	XP INVESTIMENTOS CCTVM
28/02/2023	DEFENSORIA PÚBLICA	15/05/2033	R\$ 1.997.413,76	4.043,3477691	6,2500%	494	BTG PACTUAL CTVM
28/03/2023	DEFENSORIA PÚBLICA	15/08/2040	R\$ 3.000.388,13	4.032,7797410	6,1900%	744	BGC LIQUIDEZ
18/05/2023	DEFENSORIA PÚBLICA	15/05/2025	R\$ 1.438.242,53	4.121,0387810	6,0530%	349	BGC LIQUIDEZ
19/05/2023	DEFENSORIA PÚBLICA	15/05/2025	R\$ 4.998.972,97	4.110,9975100	6,2150%	1.216	BGC LIQUIDEZ
TOTAL			R\$ 56.434.942,00			14.151	

Quadro 23.

Nota: Dados referentes as operações de Compra de Títulos Públicos realizadas desde 2014 com a descrição do ativo, Valor do ativo na compra, quantidade de papéis adquiridos e instituição financeira contraparte. A custódia é realizada pela Instituição XP Investimentos que emite Relatório com a Posição Atualizada dos Títulos.



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

5.3 Total dos Recursos – DPE/FPREV

RECURSOS DPE FPREV	SALDO	
	31/08/2023	29/09/2023
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 6.247.004,35	R\$ 7.507.455,46
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 4.385.206,85	R\$ 4.426.469,84
FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 4.073.813,63	R\$ 3.894.373,20
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 58.996.799,22	R\$ 59.432.082,41
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 17.170,72
TOTAL	R\$ 73.702.824,05	R\$ 75.277.551,63

Quadro 24.

Nota: Os valores para os Títulos Públicos são atualizados com base em Relatório com a Posição Atualizada dos Títulos.

5.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

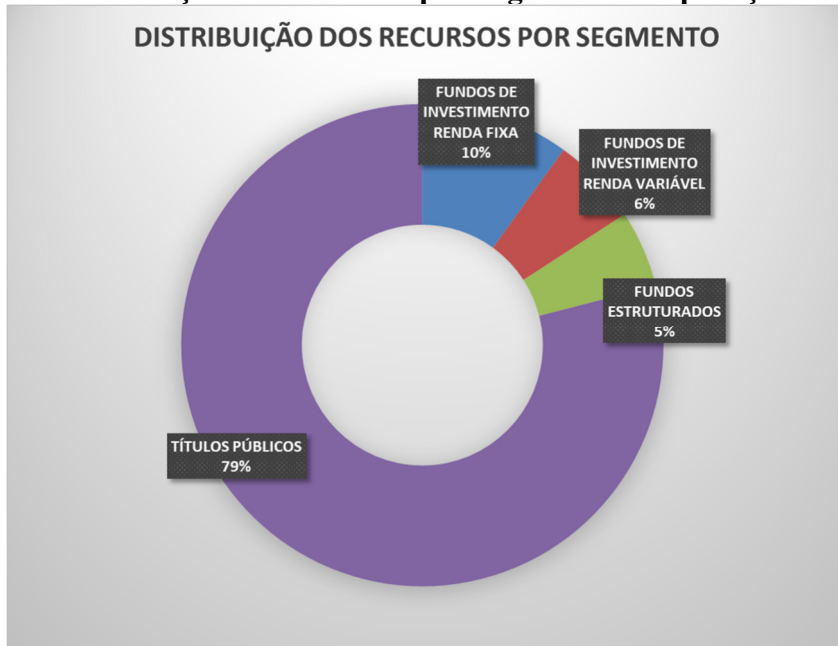


Gráfico 5.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 18/10/2023 12:18:10
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/10/2023 11:27:31

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 18/10/2023 08:52:52
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/10/2023 08:55:01
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/10/2023 08:59:59
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 18/10/2023 11:39:09
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 18/10/2023 11:55:31

Documento assinado eletronicamente 391220/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MzxxMjIw



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

5.5 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV

1. Investimentos - Defensoria

Saldo dos Investimentos em 09/2022		R\$ 51.409.195,30	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
10/2022	R\$ 1.312.094,85	R\$ 54.090,17	R\$ 1.258.004,68
11/2022	R\$ 1.325.950,25	R\$ 48.051,04	R\$ 1.277.899,21
12/2022	R\$ 1.340.533,16	R\$ 83.947,48	R\$ 1.256.585,68
01/2023	R\$ 2.652.384,33	R\$ 41.366,60	R\$ 2.611.017,73
02/2023	R\$ 1.363.583,62	R\$ 191.804,69	R\$ 1.171.778,93
03/2023	R\$ 1.361.693,00	R\$ 121.514,16	R\$ 1.240.178,84
04/2023	R\$ 1.353.367,86	R\$ 107.760,38	R\$ 1.245.607,48
05/2023	R\$ 1.366.665,90	R\$ 172.454,63	R\$ 1.194.211,27
06/2023	R\$ 1.360.589,35	R\$ 122.825,00	R\$ 1.237.764,35
07/2023	R\$ 1.361.041,17	R\$ 106.111,80	R\$ 1.254.929,37
08/2023	R\$ 1.355.445,23	R\$ 119.560,47	R\$ 1.235.884,76
09/2023	R\$ 1.340.191,95	R\$ 108.101,04	R\$ 1.232.090,91
Saldo dos Investimentos em 09/2023		R\$ 75.277.551,63	

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

Taxa de Juros Anual	5,1200%	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	5,1852 %	3,4996 %	0,2600 %
Juros	5,1200 %	3,8159 %	0,4170 %
Meta	10,5707 %	7,4491 %	0,6781 %
Rentabilidade em %	12,9735 %	9,6945 %	0,4649 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 7.652.403,12	R\$ 6.086.898,12	R\$ 342.636,67
Resultado em %	+2,1731 %	+2,0897 %	-0,2117 %
Resultado em R\$	R\$ +1.414.168,22	R\$ +1.408.306,42	R\$ -157.108,35

Quadro 25.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 18/10/2023 12:18:10
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/10/2023 11:27:31

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 18/10/2023 08:52:52
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/10/2023 08:55:01
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/10/2023 08:59:59
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 18/10/2023 11:39:09
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 18/10/2023 11:55:31

Documento assinado eletronicamente 391220/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MzxxMjW



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2023	29/09/2023	jul/23	ago/23	set/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 4.821.464,32	R\$ 9.664.536,41	-	0,6307	0,4038	1,0370%	1,0370%	NC
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 4.821.464,32	R\$ 9.664.536,41						
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 26.243.352,56	R\$ 25.871.765,57	1,1800	1,2700	1,0500	3,5409%	8,0652%	11,6706%
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ -	R\$ 4.852.251,68	1,0100	1,1000	0,9300	3,0708%	6,1728%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 26.243.352,56	R\$ 30.724.017,25						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 31.064.816,88	R\$ 40.388.553,66						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2023	29/09/2023	jul/23	ago/23	set/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 3.094.825,90	R\$ 3.062.151,83	6,1100	(6,8700)	(1,0600)	-2,2273%	16,2146%	14,8636%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 10.651.500,91	R\$ 10.638.603,55	1,8985	(3,4032)	(0,1211)	-1,6885%	11,7988%	10,8495%
OCCAM FIC FIA	R\$ 1.090.047,94	R\$ 1.098.608,08	2,8500	(5,7700)	0,7900	-2,3188%	2,1324%	0,5440%
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 1.359.097,62	R\$ 1.400.136,18	2,5100	2,4100	3,0200	8,1509%	14,3704%	17,3601%
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.578.967,81	R\$ 1.699.837,23	5,9069	(2,1346)	7,6550	11,5803%	39,2887%	32,3378%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 7.439.533,10	R\$ 7.551.399,76	5,3187	(3,3498)	1,5037	3,3214%	24,8819%	20,2724%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 4.856.691,34	R\$ 4.842.701,40	3,2800	(5,2200)	(0,2900)	-2,3951%	4,7936%	-0,4544%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 30.070.664,62	R\$ 30.293.438,03						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2023	29/09/2023	jul/23	ago/23	set/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 27.916.685,07	R\$ 27.399.633,17	2,0435	2,6274	(1,8521)	2,7850%	7,1974%	16,1304%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 27.916.685,07	R\$ 27.399.633,17						

FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2023	29/09/2023	jul/23	ago/23	set/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 21.732.360,70	R\$ 20.775.109,17	3,5900	(0,9600)	(4,4000)	-1,9187%	17,5306%	28,7277%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 21.732.360,70	R\$ 20.775.109,17						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 33.609,27	R\$ -						
TOTAL	R\$ 110.818.136,54	R\$ 118.856.734,03						

Quadro 26.

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

Nota 2: As movimentações neste mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. **202/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria, através do Despacho de 28/08/2023, constante do processo nº 2023.A.07460. **3.3 OUTROS PODERES: MPE / DPE / TJA / TCE FPREV. a) Novos Recursos:** Aplicar no fundo Caixa BRASIL FIC Gestão Estratégica RF, nesse caso, mantido o entendimento pela estratégia de gestão ativa com menor volatilidade para o momento; **b) Recursos Atuais:** Migrar os recursos aplicados no fundo Maxi Poder Público para o fundo Bradesco DI Premium. Nesse caso, foi considerado a possibilidade de desenquadramento do fundo Maxi, já comentado anteriormente, ainda, não é descartada a possibilidade de aquisição de NTN B, desde que supere a meta atuarial.



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

6.2 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

DATA DA LIQUIDAÇÃO	ORIGEM DO RECURSO / ÓRGÃO	VENCIMENTO	VALOR NA COMPRA	PU de compra (R\$)	TAXA %	QUANTIDADE	INSTITUIÇÃO CEDENTE
11/02/2022	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2023	R\$ 39.974.516,15	3.843.7034760	6,5450%	10.400	BTG PACTUAL CTVM
15/06/2022	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2023	R\$ 199.999.428,21	3.969.1088970	6,7400%	50.389	XP INVESTIMENTOS CCTVM
12/07/2022	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2035	R\$ 47.499.641,91	3.946.4559030	6,2700%	12.036	BTG PACTUAL CTVM
13/12/2022	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2025	R\$ 2.998.480,93	3.970.9698140	6,3925%	755	XP INVESTIMENTOS CCTVM
13/12/2022	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2027	R\$ 40.001.143,66	3.958.6053090	6,3100%	10.105	BGC LIQUIDEZ
15/12/2022	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/08/2024	R\$ 49.998.121,72	4.008.1867660	6,9500%	12.474	XP INVESTIMENTOS CCTVM
28/02/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/08/2040	R\$ 4.998.825,00	3.914.5066550	6,3500%	1.277	BTG PACTUAL CTVM
28/02/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2033	R\$ 13.998.069,71	4.043.3477691	6,2500%	3.462	BTG PACTUAL CTVM
01/03/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2033	R\$ 49.999.547,60	4.018.2871980	6,3460%	12.443	BGC LIQUIDEZ
28/03/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/08/2040	R\$ 9.997.260,98	4.032.7797410	6,1900%	2.479	BGC LIQUIDEZ
29/03/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2035	R\$ 9.996.111,38	4.134.0411010	6,1230%	2.418	BTG PACTUAL CTVM
30/03/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/08/2040	R\$ 9.998.250,14	4.047.8745510	6,1650%	2.470	XP INVESTIMENTOS CCTVM
31/03/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2035	R\$ 9.925.189,69	4.135.4957040	6,1330%	2.400	XP INVESTIMENTOS CCTVM
20/04/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2045	R\$ 9.998.680,70	4.159.1849840	6,1076%	2.404	BGC LIQUIDEZ
24/04/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2045	R\$ 9.995.425,52	4.164.7606320	6,1005%	2.400	BGC LIQUIDEZ
15/05/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/08/2024	R\$ 19.830.237,06	4.131.2993880	6,9900%	4.800	BRADESCO
15/05/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/08/2024	R\$ 99.998.388,61	4.127.5596900	7,0700%	24.227	XP INVESTIMENTOS CCTVM
18/05/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2025	R\$ 9.997.640,08	4.121.0387810	6,0530%	2.426	BGC LIQUIDEZ
19/05/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2025	R\$ 9.973.279,95	4.110.9975100	6,2150%	2.426	BGC LIQUIDEZ
24/05/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2025	R\$ 82.317.441,11	4.112.1711020	6,2770%	20.018	BGC LIQUIDEZ
26/06/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/08/2024	R\$ 62.001.520,92	4.156.7123700	7,3820%	14.916	BGC LIQUIDEZ
TOTAL			R\$ 793.497.201,03			196.725	

Quadro 27.

Nota: Dados referentes as operações de Compra de Títulos Públicos realizadas desde 2014 com a descrição do ativo, Valor do ativo na compra, quantidade de papéis adquiridos e instituição financeira contraparte. A custódia é realizada pela Instituição XP Investimentos que emite Relatório com a Posição Atualizada dos Títulos.

6.3 Total dos Recursos – TJ/AM-FPREV

RECURSOS TJ/AM FPREV	SALDO	
	31/08/2023	29/09/2023
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 31.064.816,88	R\$ 40.388.553,66
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 30.070.664,62	R\$ 30.293.438,03
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 27.916.685,07	R\$ 27.399.633,17
FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 21.732.360,70	R\$ 20.775.109,17
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 561.968.387,65	R\$ 566.233.167,02
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 33.609,27	R\$ -
TOTAL	R\$ 672.786.524,19	R\$ 685.089.901,05

Quadro 28.

Nota: Os valores para os Títulos Públicos são atualizados com base em Relatório com a Posição Atualizada dos Títulos.



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

6.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

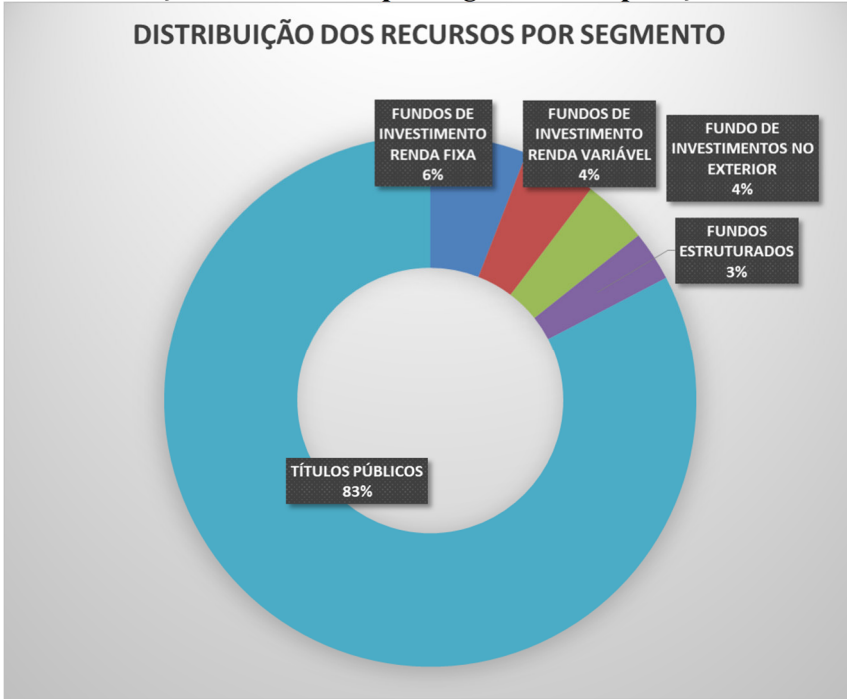


Gráfico 6

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 18/10/2023 12:18:10
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/10/2023 11:27:31

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 18/10/2023 08:52:52
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/10/2023 08:55:01
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/10/2023 08:59:59
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 18/10/2023 11:39:09
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 18/10/2023 11:55:31

Documento assinado eletronicamente 391220/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MzxxMjIw



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

6.5 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Justiça

Saldo dos Investimentos em 09/2022		R\$ 566.356.671,35	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
10/2022	R\$ 4.288.452,36	R\$ 351.916,60	R\$ 3.936.535,76
11/2022	R\$ 4.407.617,21	R\$ 355.001,41	R\$ 4.052.615,80
12/2022	R\$ 8.528.187,87	R\$ 425.895,65	R\$ 8.102.292,22
01/2023	R\$ 4.503.689,63	R\$ 316.298,28	R\$ 4.187.391,35
02/2023	R\$ 4.452.062,90	R\$ 386.831,46	R\$ 4.065.231,44
03/2023	R\$ 4.682.824,72	R\$ 954.025,73	R\$ 3.728.798,99
04/2023	R\$ 37.853,98	R\$ 416.120,94	R\$ -378.266,96
05/2023	R\$ 9.514.313,12	R\$ 826.562,19	R\$ 8.687.750,93
06/2023	R\$ 4.768.915,92	R\$ 398.809,96	R\$ 4.370.105,96
07/2023	R\$ 4.785.265,87	R\$ 584.156,10	R\$ 4.201.109,77
08/2023	R\$ 33.609,27	R\$ 678.500,13	R\$ -644.890,86
09/2023	R\$ 9.554.818,39	R\$ 572.787,56	R\$ 8.982.030,83
Saldo dos Investimentos em 09/2023		R\$ 685.089.901,05	

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	5,1852 %	3,4996 %	0,2600 %
Juros	5,1200 %	3,8159 %	0,4170 %
Meta	10,5707 %	7,4491 %	0,6781 %
Rentabilidade em %	11,0829 %	8,9745 %	0,4937 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 65.442.524,47	R\$ 54.599.850,92	R\$ 3.321.346,03
Resultado em %	+0,4632 %	+1,4197 %	-0,1831 %
Resultado em R\$	R\$ +3.022.425,27	R\$ +9.277.550,42	R\$ -1.240.510,62

Quadro 29.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 18/10/2023 12:18:10
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/10/2023 11:27:31

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 18/10/2023 08:52:52
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/10/2023 08:55:01
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/10/2023 08:59:59
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 18/10/2023 11:39:09
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 18/10/2023 11:55:31

Documento assinado eletronicamente 391220/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MzxxMjW



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2023	29/09/2023	jul/23	ago/23	set/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 3.093.143,11	R\$ 4.084.082,74	1,0100	1,1000	0,9300	3,0708%	6,1728%	NC
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 2.574.561,15	R\$ 3.176.247,30	-	0,6307	0,4038	1,0370%	1,0370%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 5.667.704,26	R\$ 7.260.330,04						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 5.667.704,26	R\$ 7.260.330,04						
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2023	29/09/2023	jul/23	ago/23	set/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 836.104,99	R\$ 827.277,69	6,1100	(6,8700)	(1,0600)	-2,2273%	16,2146%	14,8636%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT.	R\$ 10.651.500,91	R\$ 10.638.603,55	1,8985	(3,4032)	(0,1211)	-1,6885%	11,7988%	10,8495%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.723.203,12	R\$ 1.749.114,55	5,3187	(3,3498)	1,5037	3,3214%	24,8864%	20,2767%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 905.060,15	R\$ 902.453,08	3,2800	(5,2200)	(0,2900)	-2,3951%	4,7936%	-0,4544%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 14.115.869,17	R\$ 14.117.448,87						
FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2023	29/09/2023	jul/23	ago/23	set/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 533.923,65	R\$ 524.034,72	2,0435	2,6274	(1,8521)	2,7850%	7,1974%	16,1304%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 533.923,65	R\$ 524.034,72						
FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2023	29/09/2023	jul/23	ago/23	set/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 4.054.692,10	R\$ 3.876.093,92	3,5900	(0,9600)	(4,4000)	-1,9187%	17,5262%	28,7229%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 4.054.692,10	R\$ 3.876.093,92						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 24.372.189,18	R\$ 25.777.907,55						

Quadro 30.

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

Nota 2: As movimentações neste mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. **202/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria, através do Despacho de 28/08/2023, constante do processo nº 2023.A.07460. **3.3 OUTROS PODERES: MPE / DPE / TJA / TCE FPREV. a) Novos Recursos:** Aplicar no fundo Caixa BRASIL FIC Gestão Estratégica RF.

7.2 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

DATA DA LIQUIDAÇÃO	ORIGEM DO RECURSO / ÓRGÃO	VENCIMENTO	VALOR NA COMPRA	PU de compra (R\$)	TAXA %	QUANTIDADE	INSTITUIÇÃO CEDENTE
12/07/2022	TRIBUNAL DE CONTAS	15/05/2035	R\$ 16.999.871,84	3.946.4559030	6,2700%	4.308	BTG PACTUAL CTVM
13/12/2022	TRIBUNAL DE CONTAS	15/05/2027	R\$ 10.000.000,00	3.958.6053090	6,3100%	2.526	BGC LIQUIDEZ
15/12/2022	TRIBUNAL DE CONTAS	15/08/2024	R\$ 49.998.121,72	4.008.1867660	6,9500%	12.474	XP INVESTIMENTOS CCTVM
28/02/2023	TRIBUNAL DE CONTAS	15/05/2033	R\$ 18.999.690,80	4.043.3477691	6,2500%	4.699	BTG PACTUAL CTVM
06/03/2023	TRIBUNAL DE CONTAS	15/05/2035	R\$ 29.999.802,85	3.988.2747740	6,4280%	7.522	BGC LIQUIDEZ
18/05/2023	TRIBUNAL DE CONTAS	15/05/2025	R\$ 2.316.023,79	4.121.0387810	6,0530%	562	BGC LIQUIDEZ
19/05/2023	TRIBUNAL DE CONTAS	15/05/2025	R\$ 4.998.972,97	4.110.9975100	6,2150%	1.216	BGC LIQUIDEZ
TOTAL			R\$ 133.312.483,97			33.307	

Quadro 31.

Nota: Dados referentes as operações de Compra de Títulos Públicos realizadas desde 2014 com a descrição do ativo, Valor do ativo na compra, quantidade de papéis adquiridos e instituição financeira contraparte. A custódia é realizada pela Instituição XP Investimentos que emite Relatório com a Posição Atualizada dos Títulos.



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

7.3 Total dos Recursos – TCE/AM-FPREV

RECURSOS TCE/AM FPREV	SALDO	
	31/08/2023	29/09/2023
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 5.667.704,26	R\$ 7.260.330,04
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 14.115.869,17	R\$ 14.117.448,87
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 533.923,65	R\$ 524.034,72
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 137.197.800,38	R\$ 138.232.945,29
FUNDO DE INVESTIMENTOS - FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 4.054.692,10	R\$ 3.876.093,92
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 161.569.989,56	R\$ 164.010.852,84

Quadro 32.

Nota: Os valores para os Títulos Públicos são atualizados com base em Relatório com a Posição Atualizada dos Títulos.

7.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

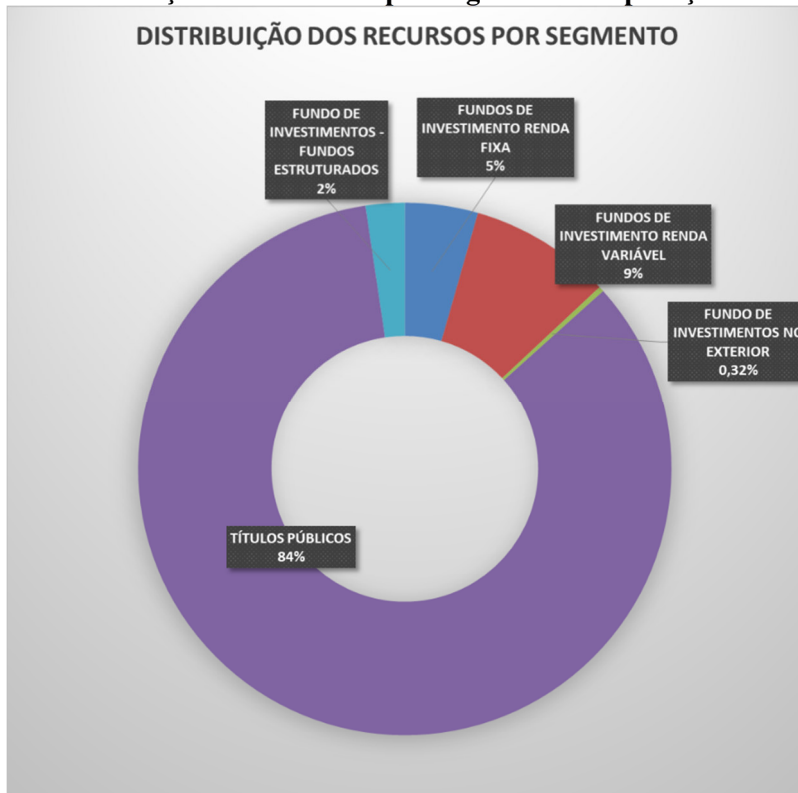


Gráfico 7.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 18/10/2023 12:18:10
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/10/2023 11:27:31

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 18/10/2023 08:52:52
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/10/2023 08:55:01
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/10/2023 08:59:59
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 18/10/2023 11:39:09
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 18/10/2023 11:55:31

Documento assinado eletronicamente 391220/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MzxxMjIw



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

7.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Contas

Saldo dos Investimentos em 09/2022		R\$ 136.118.881,89	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
10/2022	R\$ 817.771,29	R\$ 32.298,48	R\$ 785.472,81
11/2022	R\$ 957.070,80	R\$ 38.906,51	R\$ 918.164,29
12/2022	R\$ 1.730.199,65	R\$ 39.809,66	R\$ 1.690.389,99
01/2023	R\$ 818.311,18	R\$ 24.852,01	R\$ 793.459,17
02/2023	R\$ 840.406,80	R\$ 57.209,33	R\$ 783.197,47
03/2023	R\$ 868.020,15	R\$ 119.035,88	R\$ 748.984,27
04/2023	R\$ 884.821,56	R\$ 81.955,68	R\$ 802.865,88
05/2023	R\$ 893.485,01	R\$ 93.218,22	R\$ 800.266,79
06/2023	R\$ 906.009,82	R\$ 92.481,20	R\$ 813.528,62
07/2023	R\$ 1.039.877,59	R\$ 83.329,25	R\$ 956.548,34
08/2023	R\$ 542.924,76	R\$ 85.771,35	R\$ 457.153,41
09/2023	R\$ 1.698.028,43	R\$ 145.941,45	R\$ 1.552.086,98
Saldo dos Investimentos em 09/2023		R\$ 164.010.852,84	

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %		Índice de Inflação	IPCA (IBGE)	
Item	Em 12 meses	No ano	No mês		
IPCA (IBGE)	5,1852 %	3,4996 %	0,2600 %		
Juros	5,1200 %	3,8159 %	0,4170 %		
Meta	10,5707 %	7,4491 %	0,6781 %		
Rentabilidade em %	11,8962 %	8,9245 %	0,5501 %		
Rentabilidade em R\$	R\$ 16.789.852,93	R\$ 13.060.395,73	R\$ 888.776,30		
Resultado em %	+1,1988 %	+1,3732 %	-0,1271 %		
Resultado em R\$	R\$ +1.869.678,19	R\$ +2.158.631,43	R\$ -206.755,65		

Quadro 33.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 18/10/2023 12:18:10
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/10/2023 11:27:31

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 18/10/2023 08:52:52
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/10/2023 08:55:01
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/10/2023 08:59:59
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 18/10/2023 11:39:09
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 18/10/2023 11:55:31

Documento assinado eletronicamente 391220/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MzxxMjW



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV

1. Investimentos - CONSOLIDADO

Saldo dos Investimentos em 09/2022		R\$ 6.500.696.442,13	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
10/2022	R\$ 56.154.596,15	R\$ 11.305.467,55	R\$ 44.849.128,60
11/2022	R\$ 55.977.403,03	R\$ 12.023.201,52	R\$ 43.954.201,51
12/2022	R\$ 124.106.593,11	R\$ 17.179.517,14	R\$ 106.927.075,97
01/2023	R\$ 45.327.600,28	R\$ 13.697.160,01	R\$ 31.630.440,27
02/2023	R\$ 56.872.067,81	R\$ 20.127.536,33	R\$ 36.744.531,48
03/2023	R\$ 56.586.892,72	R\$ 14.866.722,41	R\$ 41.720.170,31
04/2023	R\$ 53.436.002,70	R\$ 13.694.121,29	R\$ 39.741.881,41
05/2023	R\$ 63.975.354,09	R\$ 19.217.972,94	R\$ 44.757.381,15
06/2023	R\$ 58.204.827,71	R\$ 15.438.464,68	R\$ 42.766.363,03
07/2023	R\$ 64.141.055,50	R\$ 14.109.293,00	R\$ 50.031.762,50
08/2023	R\$ 55.130.943,32	R\$ 15.200.791,24	R\$ 39.930.152,08
09/2023	R\$ 66.062.745,23	R\$ 14.835.472,83	R\$ 51.227.272,40
Saldo dos Investimentos em 09/2023		R\$ 7.627.364.277,58	

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	5,1852 %	3,4996 %	0,2600 %
Juros	5,1200 %	3,8159 %	0,4170 %
Meta	10,5707 %	7,4491 %	0,6781 %
Rentabilidade em %	8,1567 %	6,1673 %	0,4453 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 552.387.474,74	R\$ 430.060.092,00	R\$ 33.586.773,57
Resultado em %	-2,1832 %	-1,1929 %	-0,2312 %
Resultado em R\$	R\$ -163.371.083,83	R\$ -89.351.558,77	R\$ -17.555.797,95

Quadro 34.

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.



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

3. Rentabilidade Mensal x Meta Atuarial - Últimos 12 meses - CONSOLIDADO

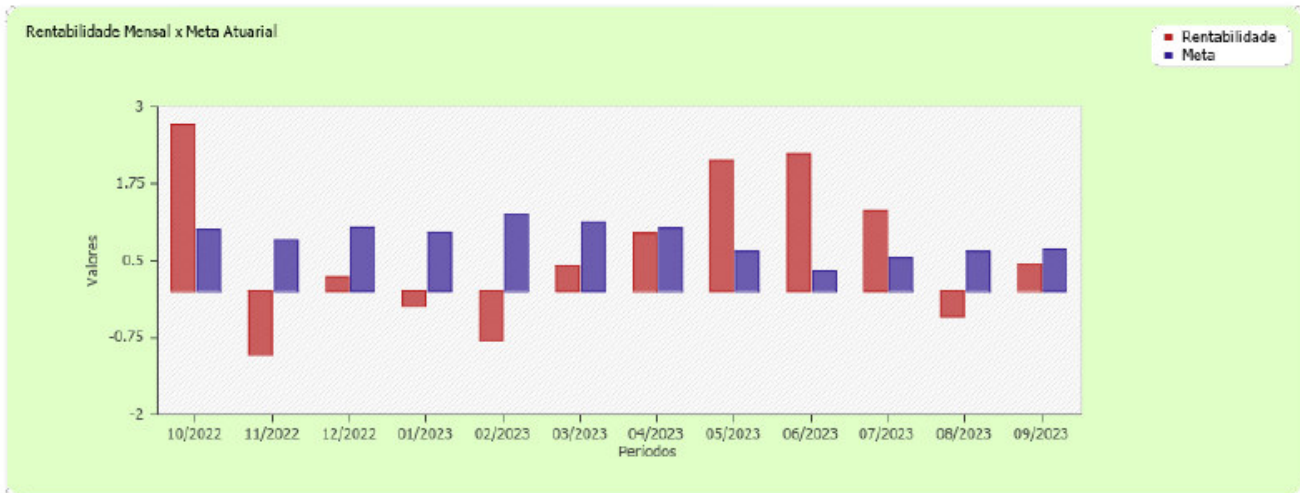


Gráfico 8.

4. Rentabilidade Acumulada x Meta Atuarial - Últimos 12 meses - CONSOLIDADO

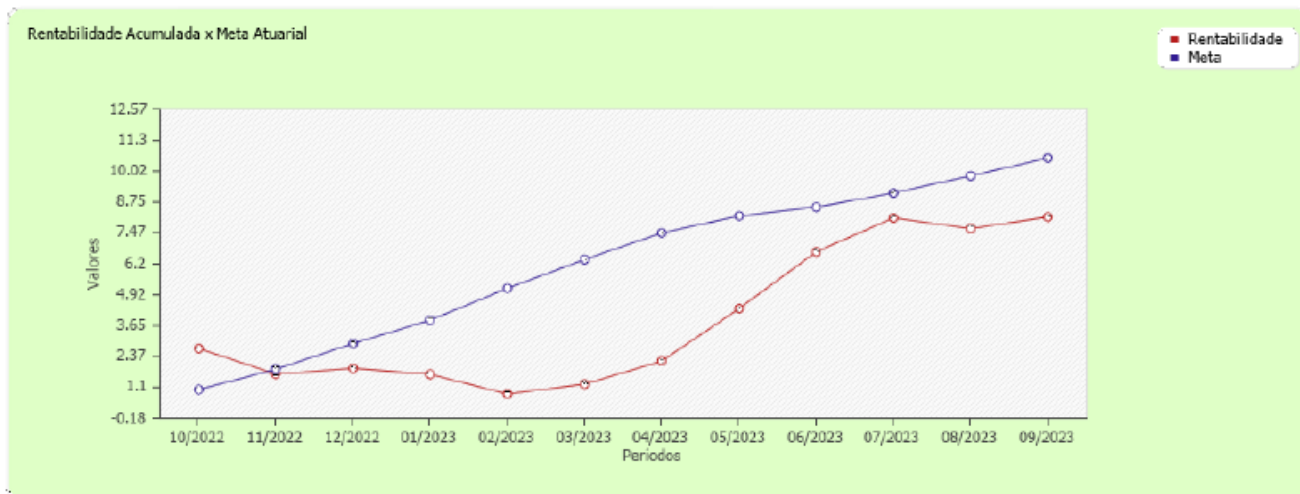


Gráfico 9.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 18/10/2023 12:18:10
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/10/2023 11:27:31

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 18/10/2023 08:52:52
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/10/2023 08:55:01
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/10/2023 08:59:59
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 18/10/2023 11:39:09
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 18/10/2023 11:55:31

Documento assinado eletronicamente 391220/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MzxxMjW



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/08/2023	29/09/2023
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.044.211,10	R\$ 1.052.225,76
FUNDO BRADESCO RF - COMPREV	R\$ 51.699.572,39	R\$ 74.422.483,43
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 5.155,96	R\$ 2.830.535,64
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 2.895.027,43	R\$ 14.463.946,17
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 237.972,51	R\$ 237.972,91
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - COMPREV	R\$ 1.123,39	R\$ 5.602,64
TOTAL	R\$ 55.883.062,78	R\$ 93.012.766,55

Quadro 35.

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

9.2 FPPM – Fundo de Proteção Previdenciária dos Militares

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/08/2023	29/09/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R\$ 5.533.179,43	R\$ 6.436.662,53
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R\$ 3.786,19	R\$ 4.614,35
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ 24.389,18	R\$ 24.357,83
TOTAL	R\$ 5.561.354,80	R\$ 6.465.634,71

Quadro 36.

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

9.3 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/08/2023	29/09/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ -	R\$ -

Quadro 37.



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/08/2023	29/09/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ 245.375,33
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 2.075,62	R\$ 71.557,39
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 3.076,75	R\$ -
TOTAL	R\$ 5.152,37	R\$ 316.932,72

Quadro 39.

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/08/2023	29/09/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 111.248,22	R\$ 750.347,81
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 111.248,22	R\$ 750.347,81

Quadro 40.

9.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/08/2023	29/09/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.160,99	R\$ 6.974.745,73
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	R\$ -	R\$ 656.540,21
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1.050,60	R\$ -
TOTAL	R\$ 3.211,59	R\$ 7.631.285,94

Quadro 41.

9.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/08/2023	29/09/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.152.163,86	R\$ 1.121.960,84
DISPONIBILIDADE COBERTURA TCE FFIN	R\$ -	R\$ 1.557.129,69
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 17.076,40
TOTAL	R\$ 1.152.163,86	R\$ 2.696.166,93
TOTAL GERAL FFIN	R\$ 62.716.193,62	R\$ 110.873.134,66

Quadro 42

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 18/10/2023 12:18:10
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/10/2023 11:27:31

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 18/10/2023 08:52:52
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/10/2023 08:55:01
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/10/2023 08:59:59
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 18/10/2023 11:39:09
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 18/10/2023 11:55:31

Documento assinado eletronicamente 391220/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MzxxMjW



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Evolução do Saldo de Taxa de Administração

DESCRIÇÃO	SALDOS			
	31/12/2021	31/07/2023	31/08/2023	29/09/2023
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.143,62	R\$ 741.212,88	R\$ 850.207,07	R\$ 2.172.585,41
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 40.560.407,77	R\$ 19.004.623,91	R\$ 19.239.753,29	R\$ 15.917.419,57
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1.159.696,10	R\$ -	R\$ -
TOTAL PODER EXECUTIVO	R\$ 40.561.552,39	R\$ 20.905.532,89	R\$ 20.089.960,36	R\$ 18.090.004,98
DESCRIÇÃO	SALDOS			
	31/12/2021	31/07/2023	31/08/2023	29/09/2023
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 35.718,27	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL - ALE	R\$ 35.718,27	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DESCRIÇÃO	SALDOS			
	31/12/2021	31/07/2023	31/08/2023	29/09/2023
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 61.970,46	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL - TCE	R\$ 61.971,46	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DESCRIÇÃO	SALDOS			
	31/12/2021	31/07/2023	31/08/2023	29/09/2023
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 605.835,00	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL TJ/AM	R\$ 605.835,00	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DESCRIÇÃO	SALDOS			
	31/12/2021	31/07/2023	31/08/2023	29/09/2023
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 199.434,03	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL PGJ/AM	R\$ 199.434,03	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL GERAL	R\$ 41.464.511,15	R\$ 20.905.532,89	R\$ 20.089.960,36	R\$ 18.090.004,98

Quadro 43.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 18/10/2023 12:18:10
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/10/2023 11:27:31

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 18/10/2023 08:52:52
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/10/2023 08:55:01
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/10/2023 08:59:59
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 18/10/2023 11:39:09
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 18/10/2023 11:55:31

Documento assinado eletronicamente 391220/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MzxxMjW



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

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 2023		Resolução CMN nº 4.963/21				
			ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE SUPERIOR					
TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL	R\$ 3.724.926.128,02	48,60%	34,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"				
TOTAL art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 3.724.926.128,02								
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 391.212.030,81	16,41%	29,00%	100,00%	art. 7º, Inciso I, "b"				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 391.533.945,79								
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 56.847.357,45								
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 134.887.354,74								
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO DI FIC REF	R\$ 86.642.688,48								
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 42.706.705,47								
ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 52.304.090,14								
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 101.550.234,80								
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 1.257.684.407,68								
BRDESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 151.800.967,68	2,34%	5,00%	70,00%	art. 7º, inciso III, "a"				
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 27.637.983,59								
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 179.438.951,27								
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 35.749.468,90	6,53%	10,00%	10,00%	art 7º, inciso V, "b"				
ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 98.191.459,42								
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 99.585.542,74								
PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R\$ 98.902.239,70								
BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF	R\$ 104.086.843,90								
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RF CRED PR	R\$ 64.019.292,92								
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 500.534.847,58								
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 5.662.584.334,55					73,87%			

Quadro 44.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 18/10/2023 12:18:10
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/10/2023 11:27:31

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 18/10/2023 08:52:52
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/10/2023 08:55:01
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/10/2023 08:59:59
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 18/10/2023 11:39:09
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 18/10/2023 11:55:31

Documento assinado eletronicamente 391220/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MzxxMjW



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

11.2 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Variável

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2023		Resolução CMN nº 4.963/21
			ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE SUPERIOR	
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 66.834.251,11	19,06%	15,00%	44,00%	art. 8º, inciso I
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 74.303.361,76				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 115.603.563,64				
BB SELEÇÃO FATOR FIC FI	R\$ 51.971.934,92				
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 105.359.085,41				
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 40.764.305,99				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 190.733.246,61				
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 35.587.530,64				
DAYCOVAL IBOVESA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.582.849,61				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 84.550.959,59				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 49.804.042,99				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 71.770.718,05				
OCCAM FIC FIA	R\$ 99.985.364,80				
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 102.817.630,46				
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 95.682.014,52				
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 42.661.304,55				
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 55.499.130,01				
TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 94.888.570,25				
TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 5.726.706,12				
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 42.782.398,81				
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 14.764.263,85				
TOTAL art. 8º, inciso I, "a"	R\$ 1.460.673.233,69				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.460.673.233,69	19,06%			

Quadro 45.

11.3 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Investimentos no Exterior

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2023		Resolução CMN nº 4.963/21
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 27.923.667,89	1,92%	1,00%	10,00%	art 9º-A, inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 32.942.226,46				
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 15.081.471,21				
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 45.704.797,02				
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 25.798.114,17				
TOTAL art 9º, inciso II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 147.450.276,75				
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 62.035.889,79	1,61%	1,00%		art 9º-A, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 29.429.423,91				
ITAU BDR NIVEL I AÇÕES	R\$ 31.830.889,70				
TOTAL art 9º, inciso III - BDR Nivel I	R\$ 123.296.203,40				
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 270.746.480,15	3,53%			

Quadro 46.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 18/10/2023 12:18:10
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/10/2023 11:27:31

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 18/10/2023 08:52:52
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/10/2023 08:55:01
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/10/2023 08:59:59
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 18/10/2023 11:39:09
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 18/10/2023 11:55:31

Documento assinado eletronicamente 391220/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MzxxMjIw



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

11.4 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Fundos Estruturados

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2023		Resolução CMN nº 4.963/21
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 36.843.687,16	1,95%	2,00%	10,00%	art. 10º, inciso I, a
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 17.716.168,69				
FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$ 16.112.432,74				
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ 19.475.103,86				
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM	R\$ 10.532.520,82				
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$ 33.040.384,39				
RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$ 16.109.796,23				
TOTAL art. 10º, inciso I, "a"	R\$ 149.830.093,89				
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 40.957.376,01	1,58%	2,00%	5,00%	art. 10º, inciso I, b
BTG PACTUAL INV DE IMPACTO CL A FIP MULT	R\$ 22.842.115,97				
BTG PACTUAL CLA ECONOMIA REAL II FIP MULT	R\$ 6.750.844,28				
CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$ 1.613.231,92				
KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$ 27.477.002,27				
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP	R\$ 21.638.591,05				
TOTAL art. 10º, inciso I, "b"	R\$ 121.279.161,50				
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 271.109.255,39	3,54%			
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 7.665.113.303,78	100%			

Quadro 47.

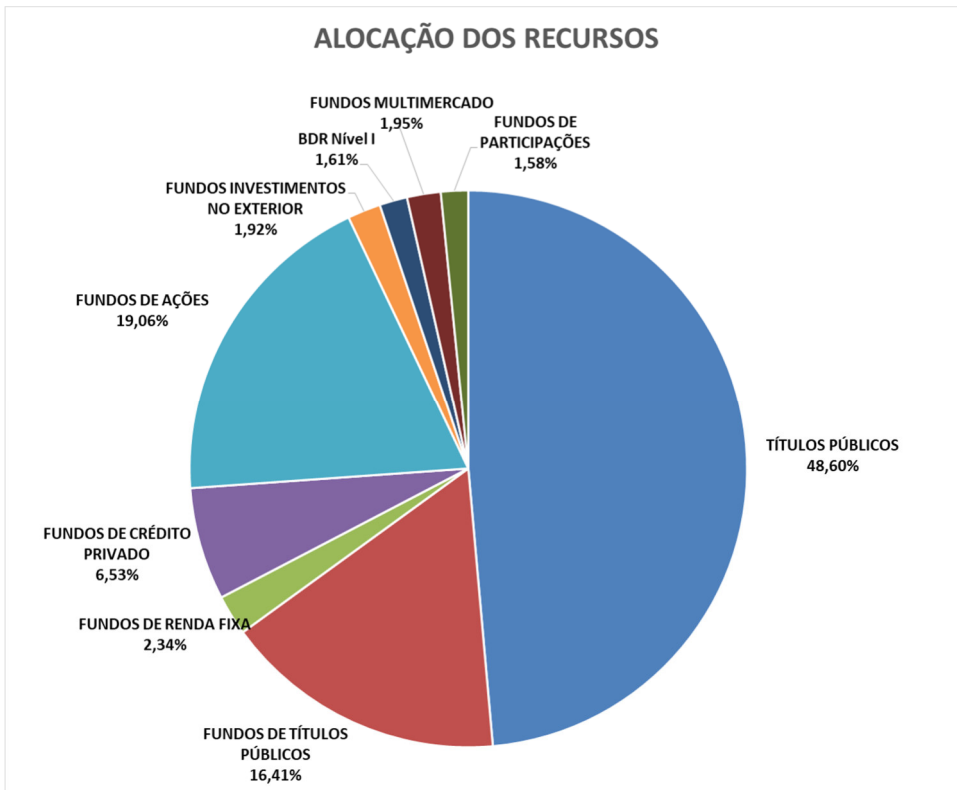


Gráfico 10.

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 18/10/2023 08:52:52
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/10/2023 08:55:01
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/10/2023 08:59:59
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 18/10/2023 11:39:09
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 18/10/2023 11:55:31

Documento assinado eletronicamente 391220/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MzxxMjIw



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

11.5 Enquadramento II – Limites Gerais – art. 18º - Res. CMN 4.963/2021

SEGMENTO DE APLICAÇÃO		TOTAL APLICADO	% CARTEIRA	LIMITE NO PL DO RPPS POR FUNDO
FI RF - 100% TPF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 56.847.357,45	0,73%	100%
	BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 101.550.234,80	1,31%	
	ITAU SOBERANO SIMPLES FIC - FUNDO NOVO	R\$ 52.304.090,14	0,67%	
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 134.887.354,74	1,74%	
	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 391.533.945,79	5,05%	
	ITAU INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 42.706.705,47	0,55%	
	SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	R\$ 86.642.688,48	1,12%	
	CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 391.212.030,81	5,04%	
FI RENDA FIXA	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 27.637.983,59	0,36%	20%
	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 151.800.967,68	1,96%	
FI RF CREDITO PRIVADO	SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 35.749.468,90	0,46%	20%
	ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 98.191.459,42	1,27%	
	BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 99.585.542,74	1,28%	
	PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R\$ 98.902.239,70	1,28%	
	BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF	R\$ 104.086.843,90	1,34%	
	SAFRA EXTRA BANCOS FIC RF CRED PR	R\$ 64.019.292,92	0,83%	
	MAG CRED PRIV FI RF LONGO PRAZO	R\$ -	0,00%	
CDB	CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE	R\$ -	0,00%	15%
FUNDOS DE AÇÕES	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 66.834.251,11	0,86%	20%
	AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 74.303.361,76	0,96%	
	BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 115.603.563,64	1,49%	
	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 51.971.934,92	0,67%	
	BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 105.359.085,41	1,36%	
	BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 40.764.305,99	0,53%	
	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 190.733.246,61	2,46%	
	CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 35.587.530,64	0,46%	
	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.582.849,61	0,24%	
	ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 84.550.959,59	1,09%	
	ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 49.804.042,99	0,64%	
	ITAU SMALL CAP VALUATION	R\$ 71.770.718,05	0,93%	
	OCCAM FIC FIA	R\$ 99.985.364,80	1,29%	
	VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 102.817.630,46	1,33%	
	GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 95.682.014,52	1,23%	
	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 42.661.304,55	0,55%	
	TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 55.499.130,01	0,72%	
	TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 94.888.570,25	1,22%	
	TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 5.726.706,12	0,07%	
	CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 42.782.398,81	0,55%	
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 14.764.263,85	0,19%		
INVEST NO EXTERIOR - FI	BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIO	R\$ 27.923.667,89	0,36%	20%
	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 32.942.226,46	0,42%	
	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 15.081.471,21	0,19%	
	SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 45.704.797,02	0,59%	
	SCHRODER SUSTENT AÇÕES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 25.798.114,17	0,33%	
FIA - BDR	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 62.035.889,79	0,80%	20%
	ITAU BDR NIVE I AÇÕES	R\$ 31.830.889,70	0,41%	
	SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 29.429.423,91	0,38%	

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 18/10/2023 12:18:10
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/10/2023 11:27:31

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 18/10/2023 08:52:52
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/10/2023 08:55:01
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/10/2023 08:59:59
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 18/10/2023 11:39:09
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 18/10/2023 11:55:31

Documento assinado eletronicamente 391220/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MzxxMjW



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

FUNDOS MULTIMERCADO	SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$	36.843.687,16	0,48%	20%
	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$	17.716.168,69	0,23%	
	FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$	16.112.432,74	0,21%	
	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$	19.475.103,86	0,25%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM - FUNDO NOVO	R\$	10.532.520,82	0,14%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$	33.040.384,39	0,43%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$	16.109.796,23	0,21%	
FIP	BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$	40.957.376,01	0,53%	20%
	KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$	27.477.002,27	0,35%	
	BTG PACTUAL CLA ECONOMIA REAL II FIP MULT	R\$	6.750.844,28	0,09%	
	CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$	1.613.231,92	0,02%	
	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP	R\$	21.638.591,05	0,28%	
	BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$	22.842.115,97	0,29%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO		R\$	3.940.187.175,76		

Quadro 48.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 18/10/2023 12:18:10
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/10/2023 11:27:31

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 18/10/2023 08:52:52
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/10/2023 08:55:01
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/10/2023 08:59:59
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 18/10/2023 11:39:09
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 18/10/2023 11:55:31

Documento assinado eletronicamente 391220/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MzxxMjW



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

11.6 Enquadramento III – Limites Gerais – art. 19º - Res. CMN 4.963/2021

SEGMENTO DE APLICAÇÃO		TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL DO FUNDO	LIMITE RESOL. CMN 4.963/21
FI RF - 100% TPF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 56.847.357,45	R\$ 229.478.681,29	24,77%	100%
	BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 101.550.234,80	R\$ 559.442.765,97	18,15%	
	CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 391.212.030,81	R\$ 8.195.443.440,71	4,77%	
	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 391.533.945,79	R\$ 6.160.923.946,07	6,36%	
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 134.887.354,74	R\$ 5.643.739.686,42	2,39%	
	ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 52.304.090,14	R\$ 39.669.959.126,67	0,13%	
	SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	R\$ 86.642.688,48	R\$ 5.478.324.181,39	1,58%	
	ITAU INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 42.706.705,47	R\$ 2.203.872.085,49	1,94%	
FI RENDA FIXA	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 151.800.967,68	R\$ 9.013.672.474,30	1,68%	15%
	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 27.637.983,59	R\$ 14.797.589.893,96	0,19%	
FI RF CREDITO PRIVADO	SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 35.749.468,90	R\$ 1.259.839.805,46	2,84%	5%
	ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 98.191.459,42	R\$ 6.366.908.858,01	1,54%	
	BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 99.585.542,74	R\$ 2.608.104.218,67	3,82%	
	PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R\$ 98.902.239,70	R\$ 3.473.055.743,33	2,85%	
	BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF	R\$ 104.086.843,90	R\$ 10.848.275.865,60	0,96%	
	SAFRA EXTRA BANCOS FIC RF CRED PR	R\$ 64.019.292,92	R\$ 2.094.567.917,17	3,06%	
FUNDOS DE AÇÕES	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 66.834.251,11	R\$ 465.488.479,68	14,36%	15%
	AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 74.303.361,76	R\$ 1.275.799.220,44	5,82%	
	BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 115.603.563,64	R\$ 880.642.275,17	13,13%	
	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 51.971.934,92	R\$ 1.338.682.696,87	3,88%	
	BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 105.359.085,41	R\$ 681.339.924,33	15,46%	
	BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 40.764.305,99	R\$ 282.112.215,20	14,45%	
	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 190.733.246,61	R\$ 1.370.470.559,17	13,92%	
	CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 35.587.530,64	R\$ 639.741.562,95	5,56%	
	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.582.849,61	R\$ 138.312.189,45	13,44%	
	ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 84.550.959,59	R\$ 646.477.640,57	13,08%	
	ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 49.804.042,99	R\$ 1.414.031.639,81	3,52%	
	ITAU SMALL CAP VALUATION	R\$ 71.770.718,05	R\$ 553.524.912,06	12,97%	
	OCCAM FIC FIA	R\$ 99.985.364,80	R\$ 823.703.571,61	12,14%	
	VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 102.817.630,46	R\$ 679.403.683,67	15,13%	
	GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 95.682.014,52	R\$ 1.214.171.436,31	7,88%	
	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 42.661.304,55	R\$ 538.649.866,95	7,92%	
	TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 55.499.130,01	R\$ 979.545.284,24	5,67%	
	TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 94.888.570,25	R\$ 786.608.043,15	12,06%	
	TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 5.726.706,12	R\$ 110.351.322,63	5,19%	
	CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 42.782.398,81	R\$ 1.290.669.768,49	3,31%	
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 14.764.263,85	R\$ 725.801.620,70	2,03%		
INVEST NO EXTERIOR - FI	BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 27.923.667,89	R\$ 1.215.627.989,81	2,30%	15%
	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 32.942.226,46	R\$ 112.215.586.951,70	0,03%	
	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 15.081.471,21	R\$ 15.566.014.099,58	0,10%	
	SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 45.704.797,02	R\$ 630.406.686,67	7,25%	
	SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 25.798.114,17	R\$ 25.467.885.980,62	0,10%	
FIA - BDR	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 62.035.889,79	R\$ 1.329.667.917,72	4,67%	15%
	ITAU BDR NIVEL I AÇÕES	R\$ 31.830.889,70	R\$ 257.475.669,19	12,36%	
	SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 29.429.423,91	R\$ 732.547.750,88	4,02%	

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 18/10/2023 12:18:10
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/10/2023 11:27:31

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 18/10/2023 08:52:52
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/10/2023 08:55:01
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/10/2023 08:59:59
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 18/10/2023 11:39:09
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 18/10/2023 11:55:31

Documento assinado eletronicamente 391220/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MzxxMjIw



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

FUNDOS MULTIMERCADO	SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 36.843.687,16	R\$ 583.410.718,64	6,32%	15%
	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 17.716.168,69	R\$ 528.109.144,51	3,35%	
	FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$ 16.112.432,74	R\$ 115.828.483,62	13,91%	
	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ 19.475.103,86	R\$ 182.063.758,36	10,70%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM - FUNDO NOVO	R\$ 10.532.520,82	R\$ 164.636.024,67	6,40%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$ 33.040.384,39	R\$ 226.291.720,75	14,60%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$ 16.109.796,23	R\$ 135.091.004,95	11,93%	
FIP	BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 40.957.376,01	R\$ 3.029.387.061,97	1,35%	15%
	KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$ 27.477.002,27	R\$ 332.412.095,08	8,27%	
	BTG PACTUAL CLA ECONOMIA REAL II FIP MULT	R\$ 6.750.844,28	R\$ 120.928.944,37	5,58%	
	CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$ 1.613.231,92	R\$ 11.498.400,09	14,03%	
	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP	R\$ 21.638.591,05	R\$ 183.802.266,19	11,77%	
	BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 22.842.115,97	R\$ 476.514.169,82	4,79%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO		R\$ 3.940.187.175,76			

Quadro 49.

Nota: Para os fundos de investimentos que compram cotas de fundos de investimentos deve ser considerado, para fins de cumprimento deste artigo, o Patrimônio Líquido do fundo máster, conforme Art. 118 da Portaria MTP 1467/2022.

Nota: Observado o Desenquadramento passivo para alguns fundos da Carteira, com resgate de cotas por outros cotistas dos fundos. Considerando o disposto na RESOLUÇÃO CMN Nº 4.963, DE 25 DE NOVEMBRO DE 2021, Art. 27. Os RPPS poderão manter em carteira, por até 180 (cento e oitenta) dias, as aplicações que passem a ficar desenquadradas em relação a esta Resolução, desde que seja comprovado que o desenquadramento foi decorrente de situações involuntárias, para as quais não tenha dado causa, e que o seu desinvestimento ocasionaria, comparativamente à sua manutenção, maiores riscos para o atendimento aos princípios previstos no art. 1º desta Resolução. § 1º Para fins do disposto no caput, são consideradas situações involuntárias: inciso II - resgate de cotas de fundos de investimento por um outro cotista, nos quais o regime próprio de previdência social não efetue novos aportes. Assim, o Comitê deve manter acompanhando sistemático desses registros de forma a encaminhar à Diretoria as sugestões de movimentações adequadas.

CONTROLE DE PRAZO DE DESENQUADRAMENTO	DT. DESENQ.	EM 15.10.23	PRAZO (180 DIAS)	MEDIDA TOMADA
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	21/08/2023	56 DIAS	16/02/2024	ANALISE DE EVOLUÇÃO DE COTAS
BRADERCO FI MID SMALL CAPS	19/06/2023	119 DIAS	15/12/2023	AGENDAR REUNIÃO COM A INST. FINAN
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	14/07/2023	33 DIAS	09/01/2024	REGULARIZADO - RESGATE DE COTAS

Quadro 50.



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

11.7 Enquadramento IV – Limites Gerais – art. 20º - A - Res. CMN 4.963/2021

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA AGOSTO/2023 EM R\$ MI	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (SETEMBRO/2023)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN n° 4.963/21
BB DTVM S.A	R\$ 1.495.005,46	R\$ 649.069.002,03	0,0434%	5%
CAIXA	R\$ 504.290,10	R\$ 681.759.793,83	0,1352%	
ITAU	R\$ 850.789,88	R\$ 346.607.905,77	0,0407%	
SAFRA	R\$ 106.892,11	R\$ 216.935.092,47	0,2029%	
BRASESCO	R\$ 627.309,52	R\$ 358.710.287,89	0,0572%	
ICATÚ	R\$ 43.762,07	R\$ 84.550.959,59	0,1932%	
BTG PACTUAL	R\$ 329.151,06	R\$ 378.585.294,30	0,1150%	
SANTANDER	R\$ 315.486,92	R\$ 81.454.265,92	0,0258%	
VINCI	R\$ 50.321,11	R\$ 147.092.166,93	0,2923%	
OCCAM	R\$ 5.751,97	R\$ 99.985.364,80	1,7383%	
PLURAL INVEST	R\$ 58.621,66	R\$ 48.023.697,67	0,0819%	
AZ QUEST	R\$ 20.671,87	R\$ 74.303.361,76	0,3594%	
BC GESTAO	R\$ 3.323,49	R\$ 40.764.305,99	1,2266%	
ARX	R\$ 26.651,09	R\$ 66.834.251,11	0,2508%	
SCHRODER	R\$ 25.180,18	R\$ 25.798.114,17	0,1025%	
DAYCOVAL	R\$ 13.023,01	R\$ 18.582.849,61	0,1427%	
GUEPARDO	R\$ 3.211,89	R\$ 95.682.014,52	2,9790%	
TRIGONO	R\$ 2.995,36	R\$ 61.225.836,13	2,0440%	
TARPON	R\$ 6.181,05	R\$ 94.888.570,25	1,5352%	
RIO BRAVO	R\$ 9.810,18	R\$ 59.682.701,44	0,6084%	
PORTO SEGURO	R\$ 22.286,55	R\$ 98.902.239,70	0,4438%	
CONSTANCIA	R\$ 1.822,11	R\$ 42.782.398,81	2,3480%	
BNP PARIBAS	R\$ 65.901,74	R\$ 104.086.843,90	0,1579%	
KINEA	R\$ 102.406,79	R\$ 27.477.002,27	0,0268%	
PATRIA INVEST	R\$ 46.193,25	R\$ 21.638.591,05	0,0468%	
CLARITAS	R\$ 7.197,06	R\$ 14.764.263,85	0,2051%	

Quadro 51.

Nota 1: 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

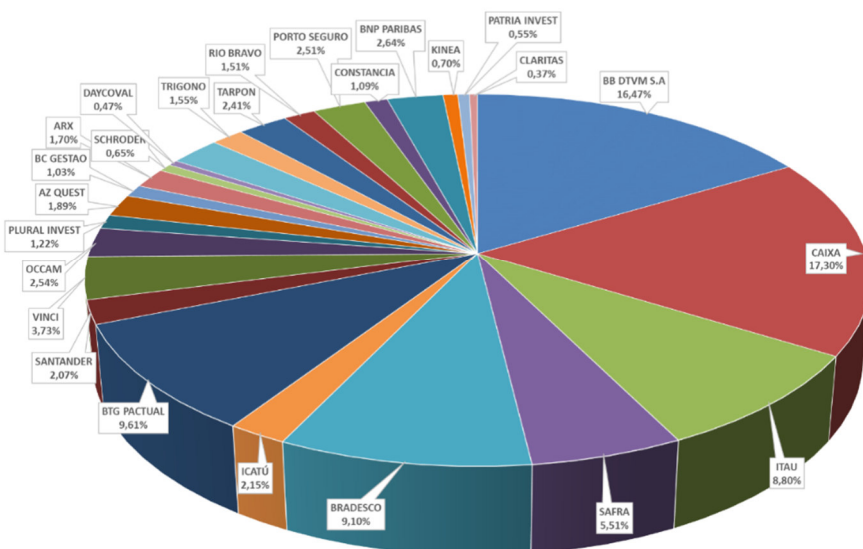


Gráfico 11.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 18/10/2023 12:18:10
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/10/2023 11:27:31

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 18/10/2023 08:52:52
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/10/2023 08:55:01
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/10/2023 08:59:59
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 18/10/2023 11:39:09
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 18/10/2023 11:55:31

Documento assinado eletronicamente 391220/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MzxxMjW



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 3.940.187.174,93
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 3.724.926.128,02
TÍTULOS - CVS	R\$ 5.842.831,69
IMÓVEIS	R\$ 65.484.778,63
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 19.886.503,95
TOTAL	R\$ 7.756.327.417,22

Quadro 52.

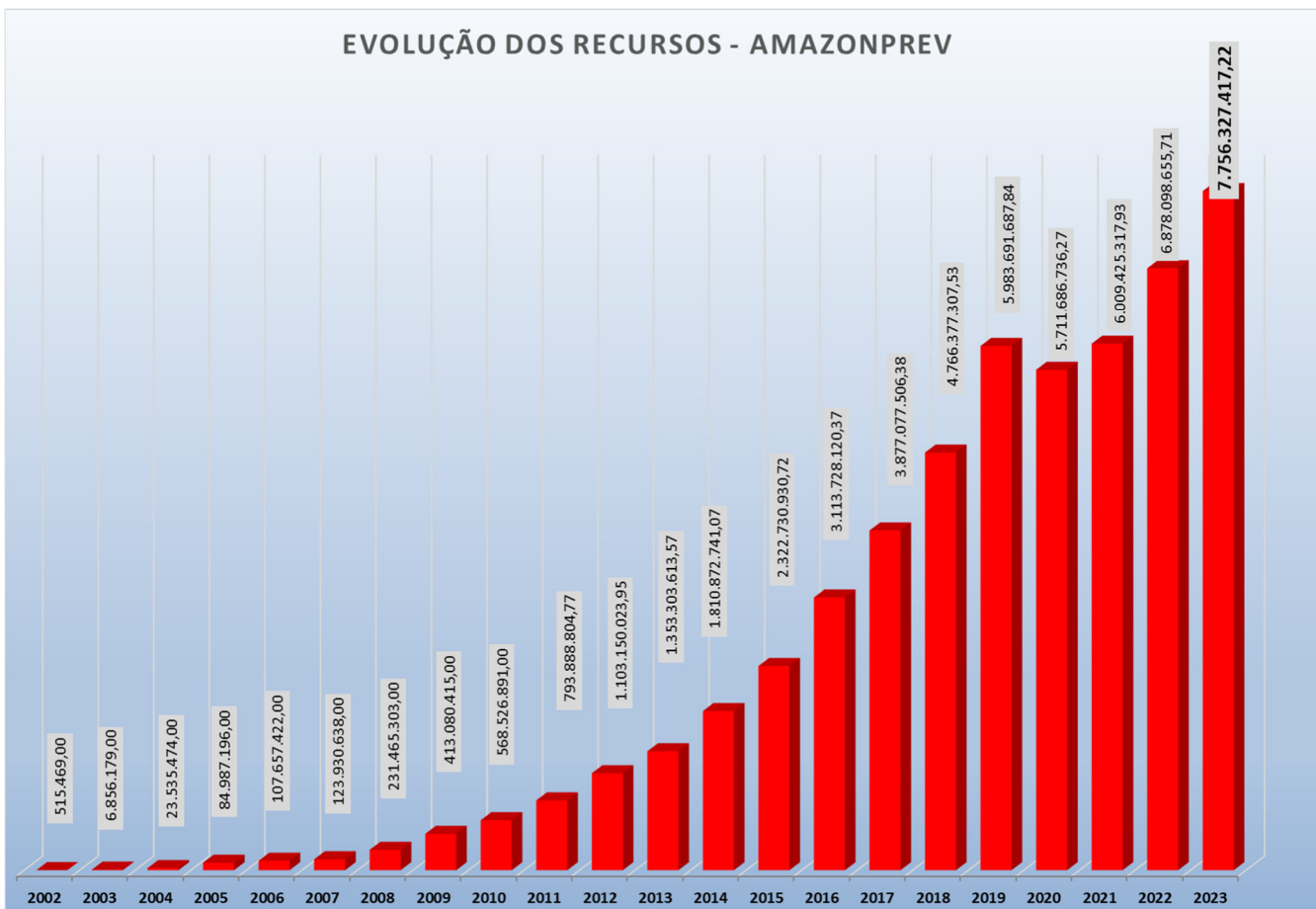


Gráfico 12.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 18/10/2023 12:18:10
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/10/2023 11:27:31

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 18/10/2023 08:52:52
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/10/2023 08:55:01
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/10/2023 08:59:59
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 18/10/2023 11:39:09
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 18/10/2023 11:55:31

Documento assinado eletronicamente 391220/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MzxxMjIw



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

13. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV/EXECUTIVO	Novos Recursos Executivo: Aplicar no fundo Safra Extra Bancos	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	17/11/2023
FPREV/ASSEMBLEIA	Novos Recursos Executivo: Aplicar no fundo Itau Alocação Dinâmica	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	17/11/2023
FPREV/TCE, TJA, MPE, DPE	Novos Recursos Executivo: Devem ser aplicados no fundo Caixa BRASIL FIC Gestão Estratégica RF (23.215.097/0001-55)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	17/11/2023
FFIN (Executivo, ALE, TCE, TJA, MPE, DPE, FPPM)	Aplicar os recursos no fundo Bradesco Maxi Poder Público, facilitando a operacionalização dos pagamentos das folhas de inativos e pensionistas desses órgãos.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	17/11/2023
RECURSOS COMPREV	Novos recursos aplicar no fundo Bradesco Maxi Poder Público.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	17/11/2023
DISPONIBILIDADES DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	Os Novos Recursos devem ser aplicados no fundo Maxi Poder Público.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	17/11/2023
REUNIÕES COM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS	Programadas reuniões com as instituições Vinci Partners e Kinea Investimentos, para atualização de informações sobre os FIPs, até 15/11/2023	COMIV	17/11/2023
AQUISIÇÃO DE TÍTULOS PÚBLICOS	Mantida a estratégia de Aquisição de Títulos Públicos Federais, conforme registrada na Ata 201/2023, bem como na Política de Investimentos 2023. Devem ser utilizados recursos aplicados em fundos indexados ao CDI, em todos os Poderes do FPREV.	COMIV / DIRAF / PRESI / GERAF / COFIN	17/11/2023
REUNIÃO COFIS/CONAD	Participação nas reuniões dos Conselhos Fiscal e de Administração, conforme definido nos Normativos Internos.	COMIV / DIRAF / PRESI / GERAF / COFIN	17/11/2023
PREENCHIMENTO E ENVIO DE INFORMAÇÕES - CADPREV	Atualização das informações sobre a Carteira do RPPS, via sistema DAIR/CADPREV	COMIV / DIRAF / PRESI / GERAF / COFIN	31/10/2023
PLANO DE APLICAÇÕES E INVESTIMENTOS	Versão Inicial aprovada pelo Comitê. Seguirá para Aprovação do CODIR e COFIS.	COMIV / DIRAF / PRESI / COFIS / CONAD	01/12/2023

Quadro 53.

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

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 18/10/2023 12:18:10
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/10/2023 11:27:31

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 18/10/2023 08:52:52
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/10/2023 08:55:01
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/10/2023 08:59:59
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 18/10/2023 11:39:09
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 18/10/2023 11:55:31

Documento assinado eletronicamente 391220/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MzxxMjW



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente **no dia 17 de outubro de 2023**, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de **setembro/2023**, 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.

O mês de setembro/2023 teve uma sensível melhora, quando comparado ao mês anterior, ainda refletindo o ritmo de recuperação da economia chinesa, e a percepção de que o FED deve levar mais tempo do que o esperado para começar a reduzir a taxa de juros americana, enquanto que o BCE indicou o encerramento do ciclo de alta de juros. O Cenário Internacional vem ditando o ritmo da melhora dos resultados do mercado interno, apesar das incertezas, as perspectivas são de resultado positivo para a Carteira da Amazonprev.

O Comitê vem acompanhando os registros de Desenquadramento passivo para alguns Fundos de Investimentos, conforme registrado no quadro 50, pág. 36 deste Relatório. Trata-se de limite com base no Patrimônio Líquido do fundo, e que nesse caso, é permitido manter em carteira, conforme decisão colegiada, por até 180 (cento e oitenta dias).

Para fins de acompanhamento, foi inserido um novo quadro, possibilitando acompanhar a evolução dos recursos aplicados em Fundos de Participação – FIP.

Todas as operações efetuadas foram devidamente autorizadas pela Diretoria, com registro nas Atas de Reunião do Comitê de 15 de setembro de 2023.



Relatório de Investimentos – Setembro/2023

Assinado Eletronicamente

Alan Nascimento
Coordenador

Bruno Costa Novo
Secretário

Claudinei Soares
Membro

Leonardo Cavalcanti
Membro

Wellington Guimaraes
Membro

Bruno Barroso
Membro

Marcos Souza
Membro

Assinado Eletronicamente

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 18/10/2023 12:18:10
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/10/2023 11:27:31

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 18/10/2023 08:52:52
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/10/2023 08:55:01
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/10/2023 08:59:59
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 18/10/2023 11:39:09
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 18/10/2023 11:55:31

Documento assinado eletronicamente 391220/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MzxxMjW

