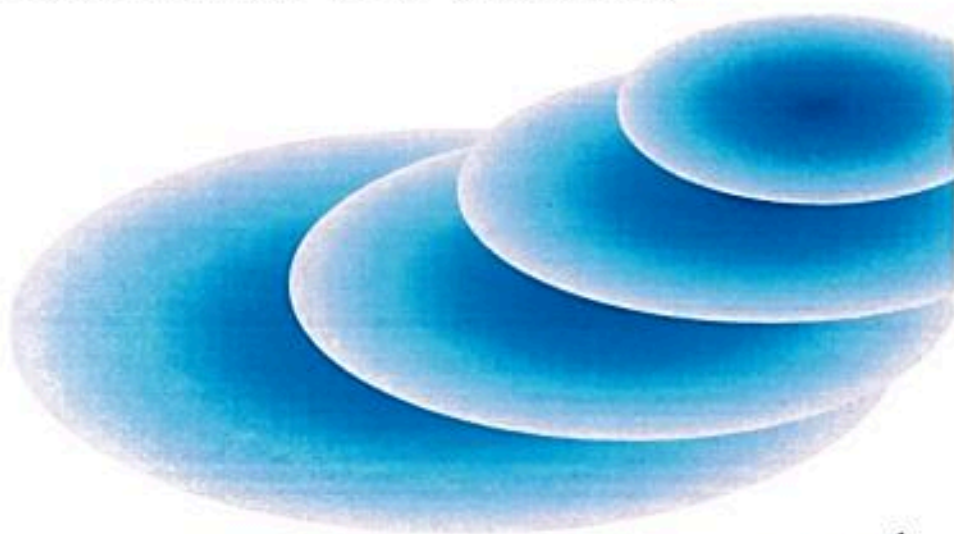




RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Novembro / 2019

RELATÓRIOS - 2019



Relatório de Investimentos Novembro de 2019

Destino: DIRAF / PRESI

Assunto: **Relatório de Investimentos – Novembro/2019**

Data: 16/12/2019

RELATÓRIO Nº. 056/2019 – COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **novembro/2019**, destacando:

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 03 a 06)
- 2) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Poder Executivo, apresentando os saldos e **performance** dos Fundos de Investimentos, evolução dos saldos dos Fundos de Investimentos, imóveis e CVS, comparativo da rentabilidade com a Meta Atuarial, Evolução e variação dos recursos do FPREV Executivo (páginas 07 a 13)
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 14 a 15)
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (página 16)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (página 17)
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (página 18)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (página 19)
- 8) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado – FPREV (página 20)
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro: Executivo, DPE, ALE e MPE – (página 21 a 22)
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 22)
- 11) Outros Recursos do Tribunal de Justiça – TJ/AM: Saldos e Composição (páginas 22)
- 12) Outros Recursos Tribunal de Contas do Estado - TCE: Saldos e Composição (páginas 23)
- 13) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 24 a 27)
- 14) Total consolidado e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 28 a 29)
- 15) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 30)
- 16) Relatório de Risco dos Ativos (páginas 31 a 34).
- 17) Verificação de Lastro dos Fundos de Risco de Crédito (página 35)
- 18) Parecer do Comitê de Investimentos (página 36).
- 19) Aprovação do Conselho Fiscal (página 37).



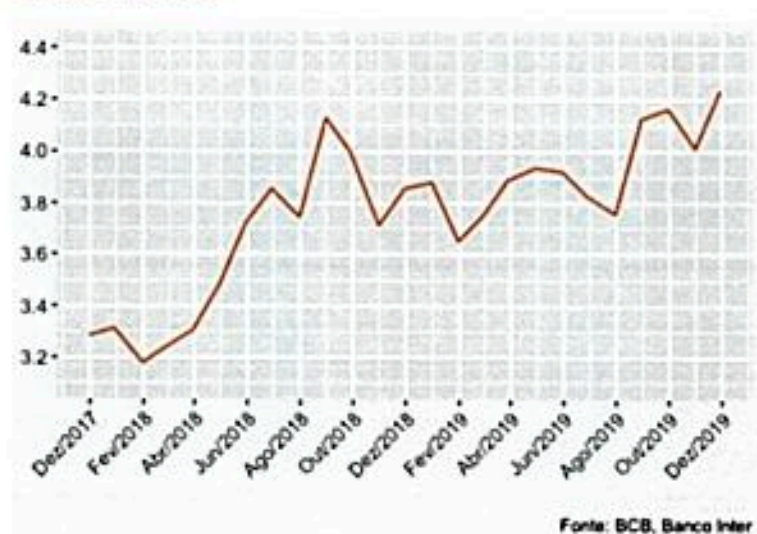
I. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

Registrado pelo Relatório Comentário Econômico, para o mês de novembro/19, emitido pelo banco Inter:

Em novembro/19 o Dólar seguiu tendência de valorização alcançando R\$ 4,24.

O dólar encerrou novembro com uma valorização de 5,5% e acumula alta de 9,4% em 2019. A desvalorização do real se acentuou a partir de agosto com o início do ciclo de cortes da taxa Selic, que vem reduzindo o diferencial de juros entre o Brasil e outros países, trazendo uma menor atratividade pela moeda local. Outros fatores vêm contribuindo para esse cenário, como a desaceleração global e uma expectativa de balanço de pagamentos mais fraco, tanto pela balança comercial como pela incerteza sobre o investimento direto estrangeiro. Por último, o fortalecimento do dólar segue uma tendência global frente às demais moedas devido às tensões comerciais e um desempenho da economia americana relativamente melhor. Essa mudança de patamar da cotação do real tende a permanecer, considerando a queda de juros no Brasil e ausência de investimentos estrangeiros significativos no curto prazo.

Dólar / Real



Inflação pode ter aceleração temporária devido a um novo choque de preços.

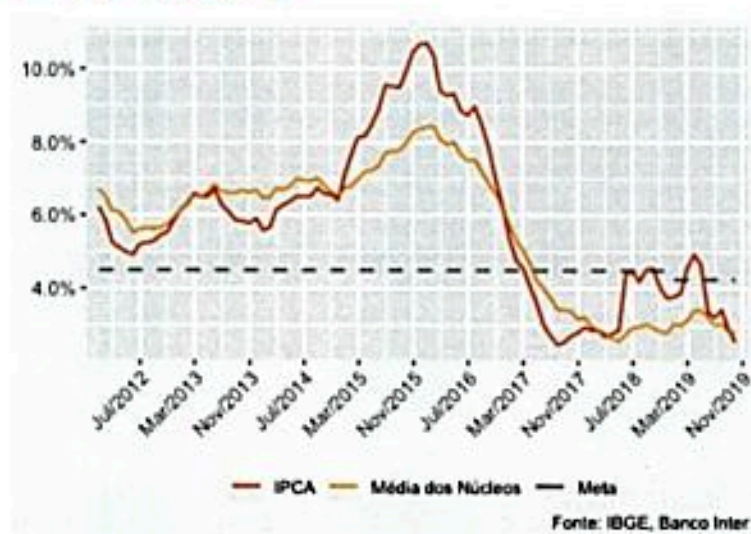
O IPCA em novembro e dezembro deve apresentar uma aceleração para entre 0,4% e 0,7%, encerrando 2019 em 3,7%. Essa aceleração, em parte esperada devido a efeitos sazonais, será mais acentuada pela alta repentina das carnes, impactada pela entressafra no mercado local combinada com a alta dos preços internacionais com a falta de carne suína na China. É esperado que a elevação do IPCA deva seguir um padrão típico de choque de oferta sem uma contaminação generalizada de

[Assinatura]
3

Relatório de Investimentos Novembro de 2019

alta de preços. No entanto, considerando o novo patamar do dólar acima de R\$4,1, é revisada a expectativa para o IPCA em 2020 para 3,8%, ainda assim, abaixo da meta de inflação do ano que é de 4%. Apesar de uma expectativa de aceleração da inflação no curto prazo, o Copom poderá cortar os juros mais uma vez em 0,5% na última reunião do ano. Considerando que a alta no índice de preços deve refletir reajustes pontuais em itens considerados voláteis pelo comitê de política monetária, o comportamento estável dos núcleos de inflação e as expectativas ancoradas abaixo da meta devem determinar que é possível mais um corte na taxa Selic para 4,5%. No entanto, o aumento da incerteza em relação à estabilidade inflacionária é um ponto de atenção, e que deve indicar o fim do ciclo de cortes.

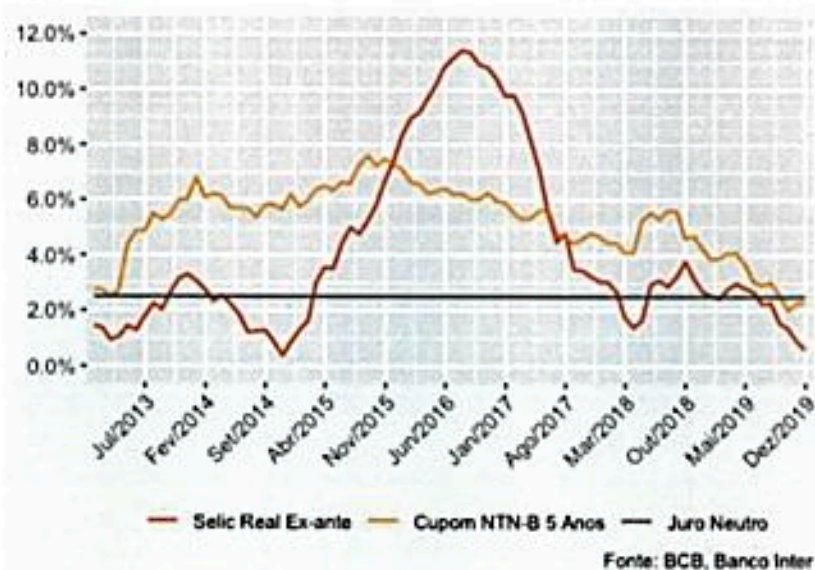
IPCA – Núcleos



Mercado de juros teve correção com expectativa de inflação maior.

Após atingir mínimas históricas, os juros de prazos mais longos voltaram a subir, refletindo uma maior incerteza em relação ao impacto da desvalorização cambial na inflação futura. Apesar dessa correção, os juros reais no Brasil, em cerca de 2,3% para prazos de 5 anos, continuam bem abaixo da média histórica. Essa mudança de patamar dos juros é estrutural e reflete os acertos na política fiscal de contenção de gastos e andamento de reformas, no entendimento do mercado financeiro. É estimado um juro neutro no Brasil entre 2,5% a 3%, e no curto prazo, a Selic a 4,5% com inflação ente 3,5% e 4% em 2020 significa um patamar estimulativo que deve contribuir para a aceleração da economia. Com a melhora da atividade e inflação chegando próxima da meta, é possível voltar a ter juros maiores a partir de 2021.

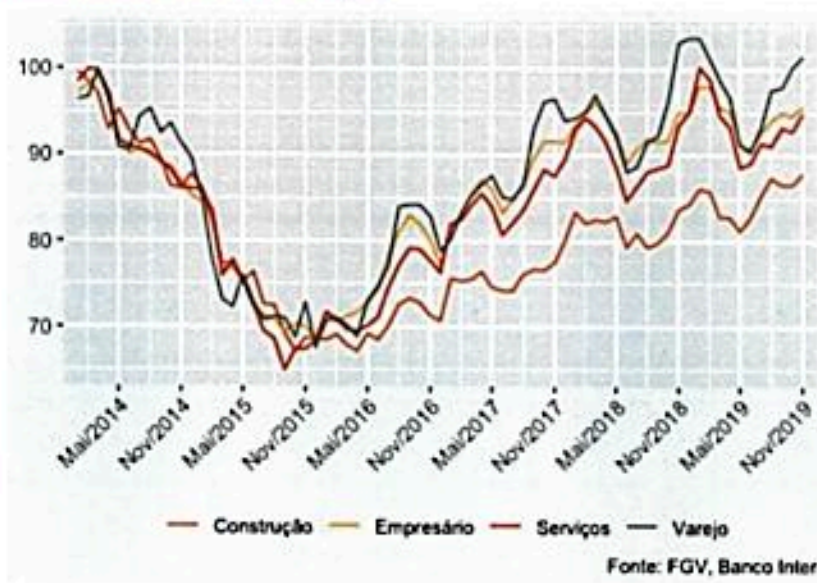
Juros reais no Brasil



PIB no 3º trimestre deve ter crescimento de 1% a.a. e espera-se uma aceleração para 1,8% no 4º trimestre.

Os dados de atividade mais recentes apontam para uma aceleração maior da economia no 4º trimestre e o PIB pode passar da taxa de 1% a.a. para próximo de 1,8%, com a contribuição do crescimento do crédito, puxado pela redução nos juros, o que vem incentivando o consumo e o investimento do setor privado. Após uma retração no começo do ano, os indicadores de confiança apontam para a potencial melhora da atividade. Os dados de sondagem da FGV indicam uma melhora da confiança em todos os setores pesquisados com destaque para o varejo, que vem crescendo nesse semestre refletindo os estímulos dos menores juros e saques do FGTS. O setor de construção também voltou a apresentar melhora no indicador de confiança depois de uma lenta recuperação lenta desde 2014.

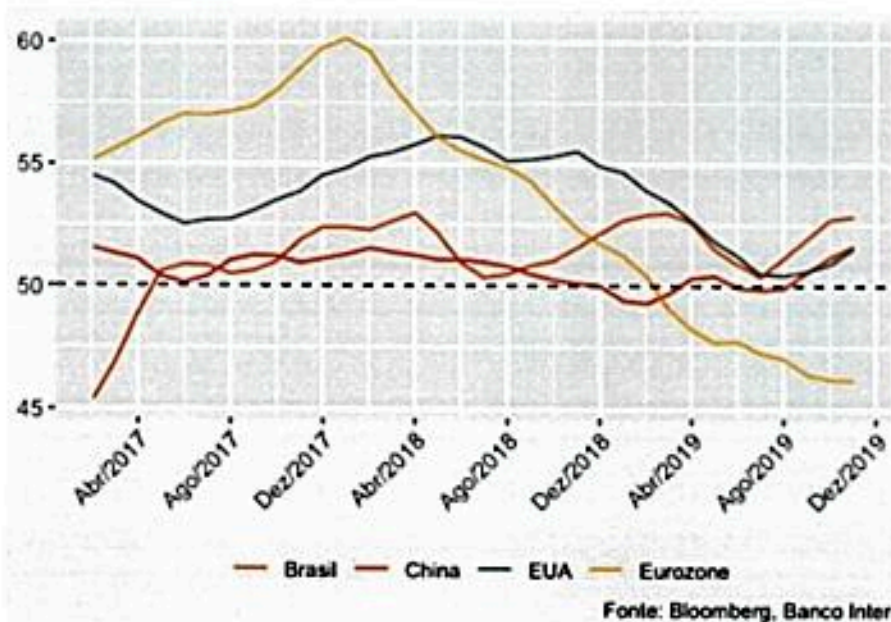
Índices de Confiança



No mercado internacional as negociações entre EUA e China podem avançar e os dados de produção industrial global já indicam uma melhora a partir de outubro.

Após uma retração no primeiro semestre, a produção industrial global indica uma leve recuperação nos últimos meses. O principal indicador de recuperação veio da China, apontando uma retomada após estímulos locais e uma possível melhora na expectativa de acerto do comércio com os EUA. Ainda assim, mantemos o cenário de moderação do crescimento em 2020, ainda com um baixo patamar de inflação global, mesmo com as baixas taxas de juros.

Produção Industrial Global



[Assinaturas manuscritas]

Relatório de Investimentos Novembro de 2019

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)				
	31/10/2019	29/11/2019	nov/19	out/19	set/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO FI RF DE PREMIUM	R\$ 269.395.263,47	R\$ 230.179.164,62	0,4569	0,4576	0,3332	1,2528%	5,4450%	5,9669%
BRASESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 73.994.307,83	R\$ 73.707.169,16	1,7580	1,6870	(0,3896)	3,0716%	11,5472%	13,0600%
BRASESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.048.285,69	R\$ 2.055.612,79	0,4429	0,4590	0,3562	1,2604%	4,8826%	5,7749%
BRASESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ -	R\$ 50.003.308,98	-	-	0,0066	0,0066%	0,0066%	NC
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF	R\$ 44.154.717,62	R\$ 44.537.083,42	0,6990	0,7369	0,8585	2,3120%	7,7885%	8,7834%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 52.467.611,49	R\$ 51.949.827,85	2,1943	2,3896	(0,9967)	3,5935%	15,7889%	17,8365%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 286.802.290,79	R\$ 285.353.658,56	2,1183	1,7103	(0,5077)	3,3765%	15,7428%	17,2759%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 779.421.554,14	R\$ 776.796.264,83	1,7201	1,6792	(0,3380)	3,0381%	11,5087%	13,0457%
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 90.740.854,56	R\$ 86.964.406,93	3,6880	4,6450	(4,3425)	3,7925%	26,2629%	28,5360%
SANTANDER FIC IMA B5 TP RF	R\$ 180.680.849,67	R\$ 180.136.637,69	1,7211	1,6327	(0,3021)	3,0660%	11,5369%	13,0382%
SANTANDER IMA B INST. TP	R\$ 24.029.226,34	R\$ 23.434.070,60	2,8447	3,3394	(2,5397)	3,5808%	5,0725%	NC
BB PREVID TP VII	R\$ 19.565.023,97	R\$ 19.649.879,22	1,0808	1,0408	0,4337	2,5819%	9,4562%	10,7277%
BB PREVID TP IX	R\$ -	R\$ -	0,4421	0,4570	-	0,9011%	4,9354%	5,4291%
BB PREVID IDKA 2	R\$ 818.716.457,17	R\$ 820.420.226,62	1,4123	1,2387	0,2081	2,8822%	9,9353%	11,2793%
BB PREVID RF IMA B5+	R\$ 270.493.184,55	R\$ 259.396.230,85	3,7075	4,6634	(4,1025)	4,0908%	26,6060%	28,9355%
BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 9.424.909,16	R\$ 9.356.501,90	-	0,4570	(0,9380)	-0,4853%	-0,4853%	NC
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 262.298.618,23	R\$ 263.213.295,00	0,7827	0,4963	0,3475	1,6349%	11,5313%	13,1927%
ICATU VANG FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 12.733.501,77	R\$ 12.624.906,17	1,6124	1,4935	(0,8002)	2,2429%	7,2469%	NC
ICATU VANG INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 53.648.843,22	R\$ 53.450.194,19	1,7443	1,6997	(0,3717)	3,0587%	6,8988%	NC
ICATU VANG INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 113.049.579,80	R\$ 108.368.462,49	3,7548	4,7088	(4,1408)	4,1218%	14,8437%	NC
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 65.379.080,80	R\$ 63.745.000,02	2,9703	3,5229	(2,4994)	3,9336%	4,5229%	NC
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 3.429.044.160,27	R\$ 3.415.321.901,89						

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)				
	31/10/2019	29/11/2019	nov/19	out/19	set/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO FIC FIA INSTIT. IBRX ALPHI	R\$ 21.251.851,05	R\$ 30.887.141,46	2,7897	2,6447	0,7310	6,2794%	7,0359%	NC
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO	R\$ 5.768.219,69	R\$ 5.914.894,42	0,3876	3,0929	2,5428	6,1241%	9,9010%	10,8120%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 4.819.504,01	R\$ 4.978.959,41	2,5056	1,7360	3,3083	7,7355%	48,6899%	48,1073%
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 70.668.017,83	R\$ 71.640.744,59	2,0595	1,9064	1,3765	5,4368%	23,2838%	23,7913%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 30.898.851,94	R\$ 31.360.951,63	2,7953	2,3875	1,4955	6,8235%	8,1412%	NC
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 63.121.490,14	R\$ 63.942.188,09	2,0406	2,8561	1,3002	6,3196%	24,7363%	24,8063%
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 142.812.566,60	R\$ 147.095.561,50	(0,4754)	0,8985	2,9980	3,4304%	26,8859%	31,5423%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 135.427.389,51	R\$ 138.000.778,68	3,4230	2,3832	1,9002	7,8998%	26,2829%	NC
SAFRA S&P REAIS	R\$ 12.326.518,71	R\$ 12.793.062,36	2,1741	2,1148	3,7849	8,2838%	28,6059%	17,0804%
SAFRA CONSUMO AMERICANO	R\$ 5.756.025,34	R\$ 6.132.936,65	0,6160	(0,7875)	6,5485	6,3605%	15,0569%	NC
ICATU VANGUARDIA DIVIDENDOS FIA	R\$ 244.443.293,07	R\$ 251.611.440,77	2,6375	1,8671	0,4561	5,0307%	32,6527%	35,6109%
ICATU VANGUARDIA AÇÕES IBX FI	R\$ -	R\$ 24.882.120,83	-	-	-	0,0000%	0,0000%	0,0000%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 62.570.039,57	R\$ 62.723.302,30	1,2517	2,3404	0,2449	3,8752%	29,8894%	33,5295%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 799.843.751,46	R\$ 831.964.682,69						
TOTAL GERAL	R\$ 4.228.997.911,73	R\$ 4.247.286.584,58						

Quadro 1.

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

Nota 2: Os Recursos de Contribuição Previdenciária recebidos no período foram direcionados para os fundos Icatu Vanguardia AÇÕES IBX FI e Bradesco FIC FIA IBRX Alpha, conforme registrado na Ata 156/2019 COMIV e aprovado pela Diretoria em Despacho de 21/11/2019.



Relatório de Investimentos Novembro de 2019

Nota 3: Direcionado o valor de R\$ 50 milhões do fundo Bradesco DI Premium para o fundo Bradesco Alocação Dinâmica, conforme registrado na Ata 156/2019 COMIV e aprovado pela Diretoria em Despacho de 21/11/2019.

2.2 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXECUTIVO

INSTITUIÇÃO	set/19	out/19	nov/19
BRADESCO	R\$ 411.704.821,84	R\$ 366.689.708,04	R\$ 386.832.397,01
BANCO DO BRASIL	R\$ 1.095.856.545,97	R\$ 1.118.199.574,85	R\$ 1.108.802.838,59
CAIXA	R\$ 1.241.119.423,90	R\$ 1.264.174.752,30	R\$ 1.256.495.095,42
ITAÚ	R\$ 580.424.375,65	R\$ 603.660.064,48	R\$ 612.251.823,27
SANTANDER	R\$ 300.555.303,63	R\$ 306.276.945,78	R\$ 306.572.404,51
ICATU/BEM DTVM	R\$ 347.241.746,51	R\$ 423.875.221,86	R\$ 450.937.124,45
SAFRA	R\$ 81.027.118,48	R\$ 83.461.604,85	R\$ 82.670.999,03
BTG PACTUAL	R\$ 61.139.090,60	R\$ 62.570.039,57	R\$ 62.723.302,30
TOTAL	R\$ 4.119.068.426,58	R\$ 4.228.907.911,73	R\$ 4.267.285.984,58

Quadro 2.

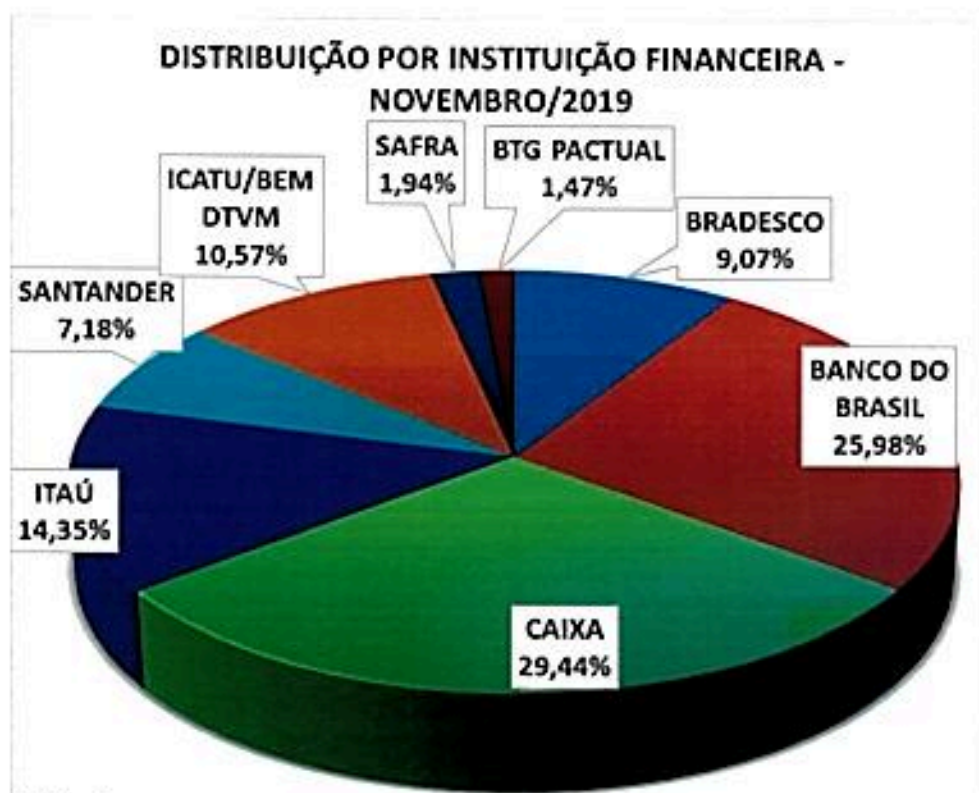


Gráfico 1

[Assinatura]
8

Relatório de Investimentos Novembro de 2019

2.3 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA

FUNDO DE INVESTIMENTO	ÍNDICE DE REFERÊNCIA	SALDO APLICADO	% APLICADO
BRADESCO FI REFER DI PREMIUM BRADESCO FI MAXI PODER PUBLICO	CDI	R\$ 232.234.777,41	5,44%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA BB PREVID ALOCAÇÃO ATIVA SAFRA CONSUMO AMERICANO SAFRA S&P REAIS BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA ITAU INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC FI	CDI ATIVO	R\$ 626.832.763,45	14,69%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF SANTANDER IMA H INST. TP	IMA B	R\$ 87.179.070,62	2,04%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5 CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP ICATU VANG. FI RF INFLA. CP ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	IMA B 5	R\$ 1.096.715.172,04	25,70%
BB PREVID IDKA 2 TP RF	IDKA 2	R\$ 820.420.226,62	19,23%
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF BB PREVID RF IMA B5+	IMA B 5+	R\$ 454.729.100,27	10,66%
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF BB PREVID TP VII BB PREVID TP IX	IPCA + 6%	R\$ 116.136.790,49	2,72%
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FI	IBR X	R\$ 55.769.262,29	1,31%
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ITAU INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO CAIXA CONSUMO FI AÇÕES ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA BTG ABSOLUTO FIQ FIA ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC	IBOVESPA	R\$ 777.268.821,39	18,21%
TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO		R\$ 4.267.285.984,58	100%

Quadro 3

DISTRIBUIÇÃO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA -
AMAZONPREV

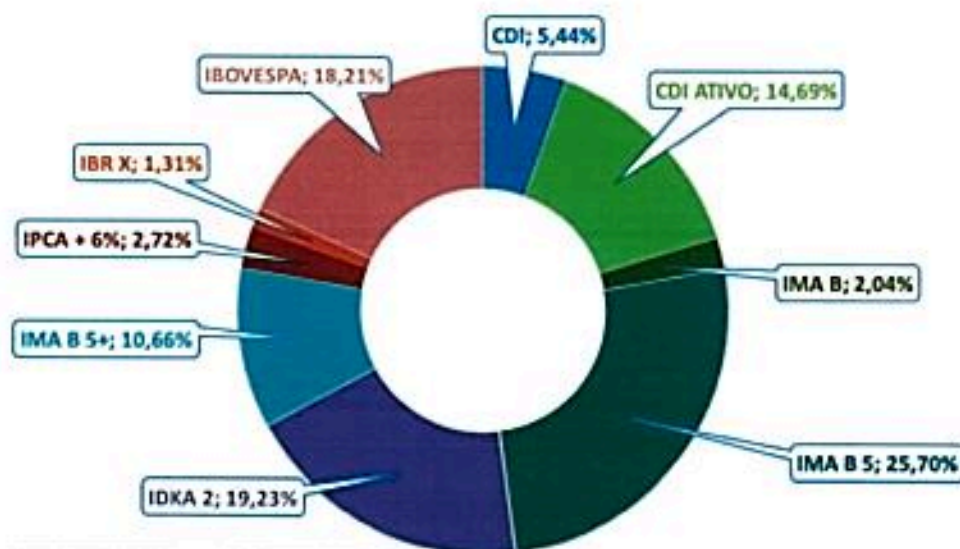


Gráfico 2.


 9

Relatório de Investimentos Novembro de 2019

2.4 COMPARATIVO DA VALORIZAÇÃO DOS ÍNDICES DE REFERÊNCIA DE MERCADO

ÍNDICE	nov/19	2019	12 MESES
CDI	0,3800%	5,5700%	6,0200%
IMA-B 5	-0,2821%	11,7736%	13,3409%
IMA-B	-2,4546%	20,5330%	22,6420%
IMA B 5+	-4,0713%	27,0608%	29,6375%
IRF M 1	0,3314%	6,3139%	6,9357%
IDKA 2	0,0144%	10,4933%	11,8858%
IBOVESPA	0,9500%	23,1500%	26,5900%

Quadro 4.



Gráfico 3.

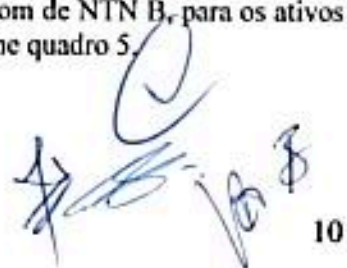
2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/10/2019	29/11/2019	nov/19	nov/19	nov/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 152.526.674,22	R\$ 149.979.150,59	0,484386	0,625121	1,037272	2,1613%	9,2293%	9,9670%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/20)	R\$ 154.318.772,08	R\$ 155.934.087,94	0,493803	0,634550	1,046740	2,1901%	9,3420%	10,0908%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/20)	R\$ 157.467.184,05	R\$ 159.152.748,43	0,517356	0,658137	1,070423	2,2619%	9,6242%	10,4008%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 159.870.937,17	R\$ 161.544.395,00	0,493818	0,634566	1,046756	2,1901%	9,3422%	10,0910%
TOTAL GERAL	R\$ 624.183.567,52	R\$ 626.610.381,96						

Quadro 5.

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

Nota 2: Recebido o valor de R\$ 4.129.639,43 referente ao pagamento de Cupom de NTN B, para os ativos com vencimento em 15/05/2023, motivo da redução do valor aplicado conforme quadro 5.


 10

Relatório de Investimentos Novembro de 2019

2.6 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
TIPO DE ATIVO	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B
INTERMEDIÁRIO	BRDESCO	BRDESCO	BRDESCO	BRDESCO
PREÇO UNITÁRIO DE COMPRA	R\$ 2.314,742871	R\$ 2.288,539269	R\$ 2.235,637189	R\$ 2.254,343911
QUANTIDADE	43.100	43.450	44.113	44.350
APLICAÇÃO INICIAL	R\$ 99.765.417,74	R\$ 99.437.031,23	R\$ 98.620.663,31	R\$ 99.980.152,45
VALOR ATUAL	R\$ 149.979.150,59	R\$ 155.934.087,94	R\$ 159.152.748,43	R\$ 161.544.395,00
DATA DE EMISSÃO	15/01/2014	10/02/2010	10/02/2010	10/02/2010
DATA DA APLICAÇÃO	15/01/2014	15/01/2014	29/01/2014	15/01/2014
DATA DO RESGATE	15/05/2023	15/08/2030	15/08/2030	15/08/2040
TAXA DE JUROS CONTRATADA	6,48%	6,5998%	6,90%	6,60%

Quadro 6.

2.7 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	31/10/2019	29/11/2019
CVS - A	R\$ 1.501.799,26	R\$ 1.484.345,94
CVS - B	R\$ 9.717.691,70	R\$ 9.604.713,90
CVS - C	R\$ 194.816,44	R\$ 192.552,36
CVS - D	R\$ 1.065.674,28	R\$ 1.053.284,76
TOTAL	R\$ 12.479.981,68	R\$ 12.334.896,96

Quadro 7.

2.8 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/19	R\$ 40.326,42	R\$ 145.084,72	R\$ 185.411,14
fev/19	R\$ 39.906,45	R\$ 145.084,72	R\$ 184.991,17
mar/19	R\$ 39.486,47	R\$ 145.084,72	R\$ 184.571,19
abr/19	R\$ 39.066,51	R\$ 145.084,72	R\$ 184.151,23
mai/19	R\$ 38.646,54	R\$ 145.084,72	R\$ 183.731,26
jun/19	R\$ 38.226,55	R\$ 145.084,72	R\$ 183.311,27
jul/19	R\$ 37.806,59	R\$ 145.084,72	R\$ 182.891,31
ago/19	R\$ 37.386,62	R\$ 145.084,72	R\$ 182.471,34
set/19	R\$ 36.966,64	R\$ 145.084,72	R\$ 182.051,36
out/19	R\$ 36.546,68	R\$ 145.084,72	R\$ 181.631,40
nov/19	R\$ 36.126,70	R\$ 145.084,72	R\$ 181.211,42
TOTAL	R\$ 420.492,17	R\$ 1.595.931,92	R\$ 2.016.424,09

Quadro 8.


 11

Relatório de Investimentos Novembro de 2019

2.9 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2019 (Contrato Regular)					
MÊS	UEA		SEAS		TOTAL
jan/19	R\$	-	R\$	-	R\$ -
fev/19	R\$	-	R\$	-	R\$ -
mar/19	R\$	116.361,92	R\$	267.638,40	R\$ 384.000,32
abr/19	R\$	58.180,96	R\$	-	R\$ 58.180,96
mai/19	R\$	58.180,96	R\$	-	R\$ 58.180,96
jun/19	R\$	116.361,92	R\$	267.638,40	R\$ 384.000,32
jul/19	R\$	-	R\$	267.638,40	R\$ 267.638,40
ago/19	R\$	58.180,96	R\$	-	R\$ 58.180,96
set/19	R\$	58.180,96	R\$	133.819,20	R\$ 192.000,16
out/19	R\$	40.067,12	R\$	133.819,20	R\$ 173.886,32
nov/19	R\$	53.422,83	R\$	-	R\$ 53.422,83
dez/19	R\$	-	R\$	267.638,40	R\$ 267.638,40
TOTAL	R\$	558.937,63	R\$	1.338.192,00	R\$ 1.897.129,63

Quadro 9.

2.10 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	30/10/2019	29/11/2019	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.228.907.911,73	R\$ 4.267.285.984,58	85,89%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 624.183.567,52	R\$ 626.610.381,96	12,61%
TÍTULOS CVS	R\$ 12.479.981,68	R\$ 12.334.896,96	0,25%
IMÓVEIS	R\$ 62.060.000,00	R\$ 62.060.000,00	1,25%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ -	0,00%
TOTAL	R\$ 4.927.631.461,93	R\$ 4.968.291.263,50	100%

Quadro 10.

2.11 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS – FPREV EXECUTIVO

Mês	Recursos FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
nov/18	R\$ 3.938.714.727,46	1,18%	17,59%	19,70%
dez/18	R\$ 4.052.222.964,81	2,88%	20,98%	20,98%
jan/19	R\$ 4.144.928.828,18	2,29%	2,29%	20,76%
fev/19	R\$ 4.198.622.173,30	1,30%	3,61%	20,77%
mar/19	R\$ 4.270.610.204,33	1,71%	5,39%	20,79%
abr/19	R\$ 4.340.813.251,38	1,64%	7,12%	21,39%
mai/19	R\$ 4.441.433.234,67	2,32%	9,60%	24,70%
jun/19	R\$ 4.560.478.660,06	2,68%	12,54%	26,72%
jul/19	R\$ 4.650.607.110,06	1,98%	14,77%	25,75%
ago/19	R\$ 4.698.765.985,21	1,04%	15,96%	25,85%
set/19	R\$ 4.814.401.867,02	2,46%	18,81%	26,83%
out/19	R\$ 4.927.631.461,93	2,35%	21,60%	26,59%
nov/19	R\$ 4.968.291.263,50	0,83%	22,61%	26,14%

Quadro 11.



Relatório de Investimentos Novembro de 2019

2.12 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo do Amazonas - EXECUTIVO2019

07/12/2019 10:53:55

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 30/11/2019	
		Saldo Financeiro em 30/11/2018	3.938.714.727,46
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
12/2018	75.239.795,82	2.413.960,02	72.825.835,80
01/2019	25.741.140,15	1.624.312,33	24.116.827,82
02/2019	36.105.221,68	1.577.166,50	34.528.055,18
03/2019	48.780.707,02	1.653.421,67	47.127.285,35
04/2019	27.254.847,98	1.484.969,43	25.769.878,55
05/2019	37.682.513,87	1.872.658,21	35.809.855,66
06/2019	41.150.382,45	1.842.441,88	39.307.940,57
07/2019	38.725.793,39	2.036.530,69	36.689.262,70
08/2019	39.885.991,44	1.920.723,93	37.965.267,51
09/2019	41.301.229,85	1.811.278,88	39.489.950,97
10/2019	40.858.104,23	2.023.186,58	38.834.917,65
11/2019	40.805.162,75	889.103,33	39.916.059,42
		Saldo Financeiro em 30/11/2019	4.968.291.263,50

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos			
Taxa de Juros Anual:	6,0000 %	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	3,2748 %	3,1202 %	0,5100 %
Juros	6,0000 %	5,4865 %	0,4868 %
Meta	9,4713 %	8,7779 %	0,9992 %
Rentabilidade %	13,3971 %	12,2366 %	0,0151 %
Rentabilidade R\$	557.195.398,86	516.512.997,31	743.742,15
Resultado %	+3,5862 %	+3,1796 %	-0,9744 %
Resultado R\$	+163.152.718,84	+145.902.361,19	-48.494.999,64

Quadro 12.

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

Quadro 13.

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/10/2019	29/11/2019	set19	out19	nov19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 4.767.453,02	R\$ 4.743.372,71	2,1183	1,7103	(0,5077)	3,3370%	15,7427%	17,2735%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 4.590.232,64	R\$ 4.606.239,54	0,7827	0,4963	0,3475	1,6349%	6,5487%	NC
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 552.660,23	R\$ 555.192,48	1,2464	1,8071	0,4561	3,6070%	3,6070%	NC
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ -	R\$ 116.604,44	-	-	-			
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 9.910.345,89	R\$ 10.021.409,17						

Quadro 14.

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


 13

Relatório de Investimentos Novembro de 2019

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos – ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/10/2019	29/11/2019	set/19	out/19	nov/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B(15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.107.300,36	R\$ 2.129.358,31	0,493803	0,634550	1,046740	2,1901%	9,3420%	10,0908%
TOTAL GERAL	R\$ 2.107.300,36	R\$ 2.129.358,31						

Quadro 15.

3.3 Composição dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS - ALE/FPREV	set/19	out/19	nov/19
SALDO ANTERIOR	11.456.007,59	11.774.465,04	12.017.646,25
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	115.124,97	117.675,84	116.604,44
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	203.332,48	125.505,37	16.516,79
SAÍDAS FINANCEIRAS	-	-	-
SALDO FINAL	11.774.465,04	12.017.646,25	12.150.767,48

Quadro 16.

3.4 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE/FPREV	SALDO	
	31/10/2019	29/11/2019
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 9.910.345,89	R\$ 10.021.409,17
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.107.300,36	R\$ 2.129.358,31
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 12.017.646,25	R\$ 12.150.767,48

Quadro 17.

3.5 Evolução dos Recursos – ALE/FPREV

Mês	Recursos ALE/FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
nov/18	R\$ 9.198.813,51	2,07%	21,44%	25,17%
dez/18	R\$ 9.650.491,60	4,91%	27,41%	27,41%
jan/19	R\$ 10.037.031,39	4,01%	4,01%	28,94%
fev/19	R\$ 10.201.534,98	1,64%	5,71%	28,95%
mar/19	R\$ 10.372.018,29	1,67%	7,48%	28,87%
abr/19	R\$ 11.181.920,91	7,81%	15,87%	35,97%
mai/19	R\$ 10.907.257,42	-2,46%	13,02%	33,82%
jun/19	R\$ 11.207.199,38	2,75%	16,13%	35,83%
jul/19	R\$ 11.373.542,16	1,48%	17,85%	33,46%
ago/19	R\$ 11.456.007,59	0,73%	18,71%	32,37%
set/19	R\$ 11.774.465,04	2,78%	22,01%	30,94%
out/19	R\$ 12.017.646,25	2,07%	24,53%	33,35%
nov/19	R\$ 12.150.767,48	1,11%	25,91%	32,09%

Quadro 18.


 14

Relatório de Investimentos Novembro de 2019

3.6 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo do Amazonas - ASSEMBLEIA2019

07/12/2019 10:49:02

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 30/11/2019	
		Saldo Financeiro em 30/11/2018	9.198.813,51
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
12/2018	365.378,12	0,00	365.378,12
01/2019	239.632,65	0,00	239.632,65
02/2019	108.995,36	0,00	108.995,36
03/2019	108.995,35	0,00	108.995,35
04/2019	118.011,62	0,00	118.011,62
05/2019	115.170,24	0,00	115.170,24
06/2019	114.154,91	0,00	114.154,91
07/2019	0,00	0,00	0,00
08/2019	116.326,93	0,00	116.326,93
09/2019	115.124,97	0,00	115.124,97
10/2019	117.675,84	0,00	117.675,84
11/2019	116.604,44	0,00	116.604,44
		Saldo Financeiro em 30/11/2019	12.150.767,48
Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos			
Taxa de Juros Anual:	6,0000 %	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	3,2748 %	3,1202 %	0,5100 %
Juros	6,0000 %	5,4865 %	0,4868 %
Meta	9,4713 %	8,7779 %	0,9992 %
Rentabilidade %	13,0217 %	11,9620 %	0,1374 %
Rentabilidade R\$	1.315.883,54	1.229.583,57	16.516,79
Resultado %	+3,2432 %	+2,9271 %	-0,8533 %
Resultado R\$	+358.414,81	+327.052,27	-103.568,04

Quadro 19.

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

15

Relatório de Investimentos Novembro de 2019

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/10/2019	29/11/2019	set19	out19	nov19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 45.307.967,95	R\$ 46.088.187,21	1,4811	1,9081	(0,9463)	2,4388%	8,1403%	NC
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B+	R\$ 13.221.502,14	R\$ 12.679.091,44	3,7075	4,6634	(4,1025)	4,0908%	3,2692%	NC
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 80.501.397,03	R\$ 80.668.922,46	1,4123	1,2387	0,2081	2,8822%	2,9359%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 4.112,97	R\$ -						
TOTAL	R\$ 139.034.980,09	R\$ 139.436.201,11						

Quadro 20.

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo do Amazonas - PGJMP2019

07/12/2019 10:56:09

Fundo Previdenciário

Cálculo Posicionado em 30/11/2019

Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
			98.872.776,18
			Saldo Financeiro em 30/11/2018
12/2018	0,00	0,00	0,00
01/2019	0,00	0,00	0,00
02/2019	0,00	0,00	0,00
03/2019	0,00	0,00	0,00
04/2019	0,00	0,00	0,00
05/2019	0,00	0,00	0,00
06/2019	10.130.614,70	0,00	10.130.614,70
07/2019	4.683.054,25	14.095,87	4.668.958,38
08/2019	4.661.168,61	0,00	4.661.168,61
09/2019	6.692.727,22	0,00	6.692.727,22
10/2019	3.644.592,21	17.678,19	3.626.914,02
11/2019	1.219.736,18	15.030,00	1.204.706,18
			Saldo Financeiro em 30/11/2019
			139.436.201,11

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual:	6,0000 %	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	3,2748 %	3,1202 %	0,5100 %
Juros	6,0000 %	5,4865 %	0,4868 %
Meta	9,4713 %	8,7779 %	0,9992 %
Rentabilidade %	8,9521 %	8,4057 %	-0,5779 %
Rentabilidade R\$	9.578.335,82	9.098.345,28	-803.485,16
Resultado %	-0,4743 %	-0,3421 %	-1,5615 %
Resultado R\$	-554.291,60	-401.943,02	-2.192.774,83

Quadro 21.

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

16

Relatório de Investimentos Novembro de 2019

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/10/2019	29/11/2019	set/19	out/19	nov/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO INST. FIC FI RF IMA BS	R\$ 9.113.108,56	R\$ 9.077.744,67	1,7580	1,6870	(0,3896)	2,7417%	2,9667%	NC
BRASESCO INST. ALOC. DINÂMICA		R\$ 778.376,33			(0,3291)	0,0000%	0,0000%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 0,00	R\$ 0,00						
TOTAL	R\$ 9.113.108,56	R\$ 9.856.121,02						

Quadro 22.

5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo do Amazonas - DEFENSORIA2019

07/12/2019 10:51:11

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 30/11/2019	
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
			Saldo Financeiro em 30/11/2018 598.798,24
12/2018	1.837.080,41	0,00	1.837.080,41
01/2019	0,00	0,00	0,00
02/2019	610.322,80	0,00	610.322,80
03/2019	627.819,72	0,00	627.819,72
04/2019	637.839,76	0,00	637.839,76
05/2019	648.474,00	0,00	648.474,00
06/2019	664.320,93	0,00	664.320,93
07/2019	683.371,79	0,00	683.371,79
08/2019	775.936,11	0,00	775.936,11
09/2019	779.947,37	0,00	779.947,37
10/2019	784.381,09	0,00	784.381,09
11/2019	780.946,33	0,00	780.946,33
			Saldo Financeiro em 30/11/2019 9.856.121,02
Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos			
Taxa de Juros Anual:	6,0000%	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	3,2748%	3,1202%	0,5100%
Juros	6,0000%	5,4865%	0,4868%
Meta	9,4713%	8,7779%	0,9992%
Rentabilidade %	9,0999%	8,2850%	-0,4163%
Rentabilidade R\$	426.882,47	421.311,07	-37.933,87
Resultado %	-0,3393%	-0,4531%	-1,4015%
Resultado R\$	-17.207,56	-24.831,20	-128.995,47

Quadro 23.

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

Relatório de Investimentos Novembro de 2019

6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/10/2019	29/11/2019	10/19	11/19	12/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 15.027.138,35	R\$ 17.248.921,31	1,7580	1,6870	(0,3896)	3,0716%	4,9255%	NC	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -							
TOTAL	R\$ 15.027.138,35	R\$ 17.248.921,31							

Quadro 24.

Nota: A disponibilidade Financeira registrada refere-se a valores consignados à folha de pagamento do TJ/AM, já regularizados em outubro/2019.

6.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo do Amazonas - TRIBUNALDEJUSTICA2019

07/12/2019 10:59:06

Fundo Previdenciário

Cálculo Posicionado em 30/11/2019

Mês/Ano	Saldo Financeiro em 30/11/2018		Resultado R\$
	Receitas R\$	Despesas R\$	
12/2018	0,00	0,00	0,00
01/2019	0,00	0,00	0,00
02/2019	0,00	0,00	0,00
03/2019	1.124.231,98	0,00	1.124.231,98
04/2019	1.129.159,87	0,00	1.129.159,87
05/2019	1.132.493,24	0,00	1.132.493,24
06/2019	1.138.021,63	241.430,62	896.591,01
07/2019	2.565.437,98	291.519,39	2.273.918,59
08/2019	3.884.077,90	67.916,92	3.816.160,98
09/2019	2.508.252,24	494.376,53	2.013.875,71
10/2019	2.781.927,34	277.820,43	2.504.106,91
11/2019	2.561.139,60	248.791,25	2.312.348,35
	Saldo Financeiro em 30/11/2019		17.248.921,31

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual:	6,0000 %	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	3,2748 %	3,1202 %	0,5100 %
Juros	6,0000 %	5,4865 %	0,4868 %
Meta	9,4713 %	8,7779 %	0,9992 %
Rentabilidade %	1,0028 %	0,9188 %	-0,6027 %
Rentabilidade R\$	46.034,67	46.034,67	-90.565,39
Resultado %	-7,7359 %	-7,2249 %	-1,5861 %
Resultado R\$	-378.463,92	-384.650,83	-240.722,19

Quadro 25.

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

18

Relatório de Investimentos Novembro de 2019

7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/10/2019	29/11/2019	set19	out19	nov19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO INST. FIC FIC FIM A B 5	R\$ 1.931.682,23	R\$ 3.260.451,82	1,7180	1,6870	(0,3896)	3,2409%	3,2409%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 447.922,04	R\$ -						
TOTAL	R\$ 2.379.604,27	R\$ 3.260.451,82						

Quadro 26.

Nota: A disponibilidade Financeira registrada refere-se a valores recebidos após horário permitido para aplicação. Regularizado em outubro/2019.

7.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo do Amazonas - TRIBUNALDECONTAS2019

07/12/2019 11:01:06

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 30/11/2019	
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
			0,00
			Saldo Financeiro em 30/11/2018
12/2018	0,00	0,00	0,00
01/2019	0,00	0,00	0,00
02/2019	0,00	0,00	0,00
03/2019	0,00	0,00	0,00
04/2019	0,00	0,00	0,00
05/2019	0,00	0,00	0,00
06/2019	446.815,11	0,00	446.815,11
07/2019	449.663,70	0,00	449.663,70
08/2019	456.011,93	0,00	456.011,93
09/2019	526.068,24	0,00	526.068,24
10/2019	447.922,04	0,00	447.922,04
11/2019	889.854,89	0,00	889.854,89
			Saldo Financeiro em 30/11/2019
			3.260.451,82
Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos			
Taxa de Juros Anual:	6,0000%	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	3,2748%	3,1202%	0,5100%
Juros	6,0000%	5,4865%	0,4868%
Meta	9,4713%	8,7779%	0,9992%
Rentabilidade %	7,8788%	7,1991%	-0,3785%
Rentabilidade R\$	44.115,91	44.115,91	-9.007,34
Resultado %	-1,4548%	-1,4514%	-1,3641%
Resultado R\$	-8.642,26	-9.407,37	-32.785,24

Quadro 27.

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

19

Relatório de Investimentos Novembro de 2019

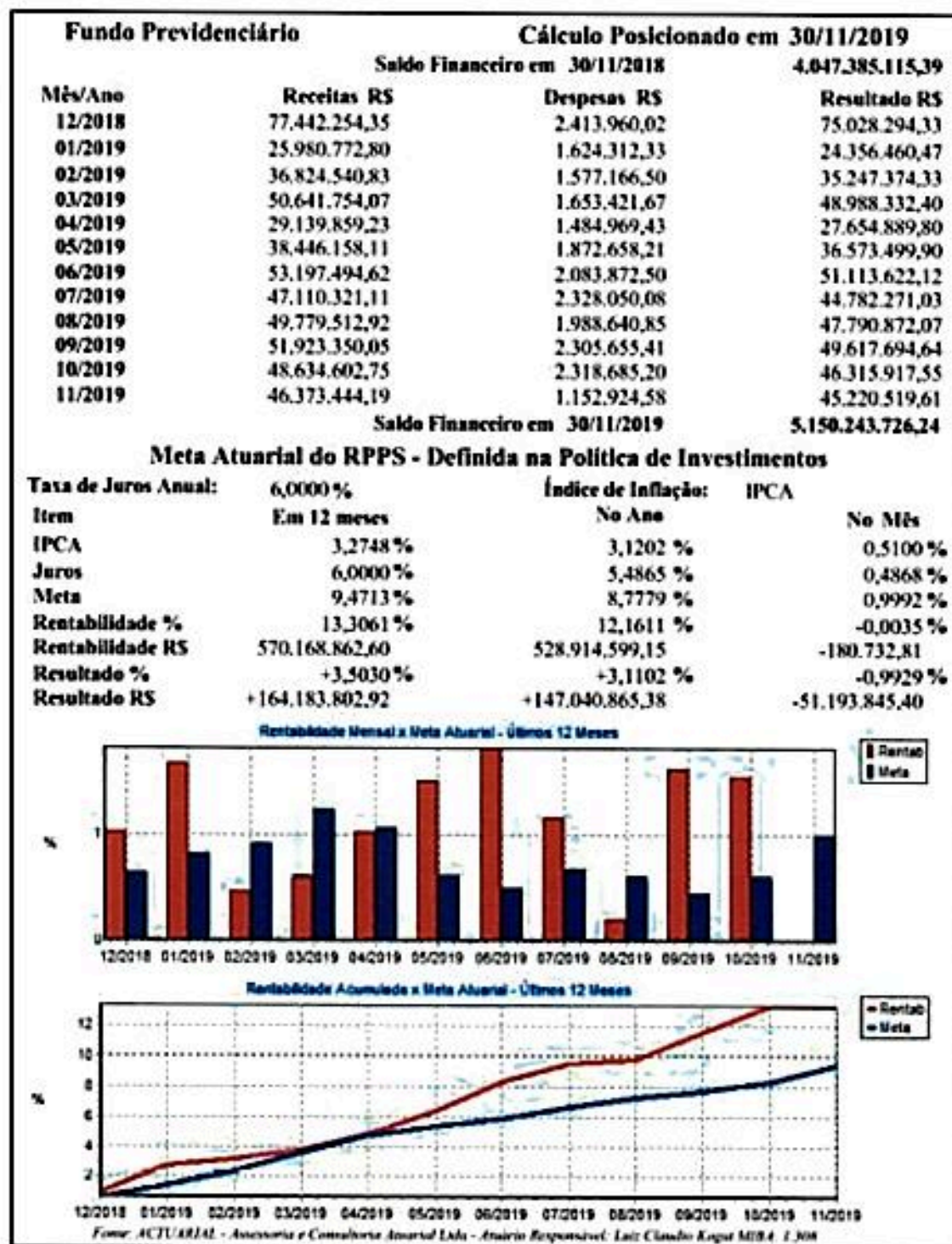
8. CONSOLIDADO – FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo do Amazonas - CONSOLIDADO2019

07/12/2019 11:02:57



Quadro 28.

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

[Handwritten signature]
20

Relatório de Investimentos Novembro de 2019

9. RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/10/2019	29/11/2019
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	602.109,51	35.646.812,27
BRDESCO FIC FIRR ALOC. DINÂMICA - COMPREV	R\$ 3.862.015,29	R\$ 3.908.443,57
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ -	R\$ -
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 8.436.129,36	R\$ 33.489,10
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 61.982,37	R\$ 207.615,53
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 770,00
TOTAL	R\$ 12.962.237,53	R\$ 39.797.130,47

Quadro 29.

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

Nota 2: O saldo de Cobertura do Déficit refere-se aos valores de IRRF sobre as folhas de aposentados e pensionistas, já regularizados em novembro/2019.

9.2 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/10/2019	29/11/2019
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ 291.170,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 140,76	R\$ -
TOTAL	R\$ 140,76	R\$ 291.170,00

Quadro 30.

9.3 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/10/2019	29/11/2019
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 207.343,82	R\$ 377.517,95
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 207.344,82	R\$ 377.518,95

Quadro 31.

9.4 Composição do Recursos – ALE FFIN

DESCRIÇÃO	set/19	out/19	nov/19
SALDO ANTERIOR	R\$ 201.137,82	R\$ 277.172,34	R\$ 207.344,82
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	R\$ 937.433,79	R\$ 935.792,49	R\$ 909.931,15
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ 1.433.159,86	R\$ 1.439.142,00	R\$ 988.062,80
VARIAÇÃO FINANCEIRA	R\$ 1.696,03	R\$ 2.030,81	R\$ 1.195,61
(-) SAIDAS FINANCEIRAS	-R\$ 2.296.255,16	-R\$ 2.446.792,82	-R\$ 1.729.015,43
SALDO FINAL	R\$ 277.172,34	R\$ 207.344,82	R\$ 377.518,95

Quadro 32.



Relatório de Investimentos Novembro de 2019

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/10/2019	29/11/2019
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 352.423,49	R\$ 754.335,47
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ 380.480,87	R\$ 187.418,23
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 732.904,36	R\$ 941.753,70

Quadro 33.

10. TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/10/2019	29/11/2019	set19	out19	nov19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.133.717,59	R\$ 2.261.540,10	0,4429	0,4560	0,3562	1,2604%	5,3012%	4,7576%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 41.577.213,00	R\$ 41.367.207,38	2,1183	1,7103	(0,5077)	3,3376%	4,7741%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ -						
TOTAL	R\$ 43.710.931,59	R\$ 43.628.747,48						

Quadro 34.

10.2 Taxa de Administração - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/10/2019	29/11/2019	set19	out19	nov19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 690.889,04	R\$ 758.006,64	0,4429	0,4560	0,3562	1,2603%	5,3520%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 32.497,86	R\$ 0,00						
TOTAL	R\$ 723.386,90	R\$ 758.006,64						

Quadro 35.

10.3 Taxa de Administração - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/10/2019	29/11/2019	set19	out19	nov19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 138.089,66	R\$ 256.257,43	-	0,4560	0,3562	0,8138%	0,8138%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	-	-						
TOTAL	R\$ 138.089,66	R\$ 256.257,43						

Quadro 36.

11. OUTROS RECURSOS

11.1 Tribunal de Justiça do Estado - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/10/2019	29/11/2019	set19	out19	nov19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADERCO IRF MI - TJA	R\$ 22.381.409,81	R\$ -	0,6212	0,6016	0,2655	1,4953%	6,0093%	6,5803%
BRADERCO FI REF. DI PREMIUM	R\$ -	R\$ 23.938.773,14						
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TJA	R\$ 184.733.060,70	R\$ 185.313.791,06	0,6268	0,6068	0,3144	1,5556%	6,1250%	6,7005%
BB PREV. RF IRF MI - TJA	R\$ 180.710.774,36	R\$ 181.265.354,27	0,6193	0,5987	0,3068	1,5323%	6,0708%	6,6393%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 5.354.229,30	R\$ -						
TOTAL	R\$ 393.179.474,17	R\$ 390.517.920,47						

Quadro 37.



Relatório de Investimentos Novembro de 2019

11.2 Composição dos Saldos - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	set/19	out/19	nov/19
SALDO ANTERIOR	399.140.654,65	397.718.758,37	393.179.474,17
CONTRIB. PREVIDENCIÁRIA	5.536.233,95	5.545.375,90	5.671.046,97
VARIAÇÃO FINANCEIRA	2.480.957,64	903.334,51	1.194.740,16
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(9.439.087,87)	(10.987.994,61)	(9.527.340,83)
SALDO FINAL	RS 397.718.758,37	RS 393.179.474,17	RS 390.517.920,47

Quadro 38.

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

11.3 Tribunal de Contas do Estado - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/10/2019	29/11/2019	set/19	out/19	nov/19	TRIMESTRE	2019	ULTIMOS 12 MESES
BRANCO IRF MI - TCE	R\$ 7.061.838,29	R\$ -	0,6212	0,6016	0,2655	1,4953%	6,0093%	6,5803%
BRANCO FI REF. DI PREMIUM	R\$ -	R\$ 7.799.796,42						
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TCE	R\$ 72.678.914,48	R\$ 72.867.263,59	0,6268	0,6068	0,3144	1,5556%	6,1250%	6,7005%
IB PREV. RF IRF MI - TCE	R\$ 70.923.245,37	R\$ 71.140.900,39	0,6193	0,5987	0,3068	1,5323%	6,0708%	6,6393%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 3.215.734,83	R\$ 730.809,42						
TOTAL	RS 153.839.732,97	RS 152.538.769,82						

Quadro 39.

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

11.4 Composição dos Saldos - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	set/19	out/19	nov/19
SALDO ANTERIOR	156.783.790,54	155.668.630,53	153.839.732,97
CONTRIB. PREVIDENCIÁRIA	2.368.358,95	1.738.581,72	2.670.383,28
VARIAÇÃO FINANCEIRA	972.482,79	915.133,66	464.465,88
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(4.456.001,75)	(4.482.612,94)	(4.435.812,31)
SALDO FINAL	RS 155.668.630,53	RS 153.839.732,97	RS 152.538.769,82

Quadro 40.

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

Relatório de Investimentos Novembro de 2019

12. ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS

12.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2019		LIMITE DA RESOLUÇÃO	Resolução CMN nº 3.923/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR		
TÍTULOS DO TN	R\$ 628.739.740,27	11,00%	11%	100%	100%	art. 7º, inciso I, "a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM I FIC FI	R\$ 252.406.254,66	54,11%	50%	100%	100%	art. 7º, inciso I, "a"
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 19.649.879,22					
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDA B5+ TP	R\$ 272.075.322,29					
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDA 2	R\$ 901.089.149,08					
SANTANDER FIC IDA B-5	R\$ 180.136.637,69					
SANTANDER IDA B INST TP RF LP	R\$ 23.434.070,60					
CAIXA FI BRASIL IRF M I TP RF	R\$ 258.181.054,65					
CAIXA FI BRASIL IDA B5 TP RF LP	R\$ 776.796.264,83					
CAIXA FI BRASIL IDA B5+ TP RF LP	R\$ 86.964.806,93					
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 44.537.083,42					
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 51.949.827,85					
ICATU VANG INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 53.450.194,19					
ICATU VANG INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 108.368.462,49					
SAFRA IDA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 63.745.000,02					
BRABESCO MANE PODER PÚBLICO	R\$ 42.401.252,65	19,54%	40%	40%	40%	art. 7º, inciso IV, "a"
BRABESCO FI REFERENCIADO DE PREMIUM	R\$ 261.917.736,18					
BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IDA B5	R\$ 103.294.286,96					
BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 100.778.316,11					
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 9.336.501,90					
ITAÚ INST. ALDC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 267.819.534,54					
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 331.464.238,65					
ICATU VANG FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 12.741.510,61	0,22%	1%	2%	5%	art. 7º, inciso VII, "a"
TÍTULOS CVS	R\$ 12.334.896,96	0,22%	ALÍQUOTA DE 15% PARA TÍTULOS DE RENDIMENTO FIXO	ALÍQUOTA DE 15% PARA TÍTULOS DE RENDIMENTO FIXO	-	TÍTULOS DE RENDIMENTO FIXO
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 4.803.411.622,75	85,89%				

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2019		LIMITE DA RESOLUÇÃO	Resolução CMN nº 3.923/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR		
BRABESCO INST IDR X ALPHA	R\$ 30.887.141,46	0,98%	8%	15%	20%	art. 8º, inciso I, "a"
ICATU VANGUARDIA AÇÕES IDR FI	R\$ 24.882.120,83					
ITAÚ FOF RFI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 63.942.188,09	13,50%	8%	15%	20%	art. 8º, inciso II, "a"
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 4.978.959,41					
ITAÚ INST AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 147.099.561,50					
ITAÚ AÇÕES DUNAMES FIC	R\$ 338.060.738,68					
ICATU VANGUARDIA DIVIDENDOS FIA	R\$ 252.166.633,25					
BTG ABSOLUTO INST FFI FIA	R\$ 62.723.302,30					
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 31.360.951,63					
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 71.640.744,59					
SAFRA S&P REAIS PD FIC MULTIMERCADO	R\$ 12.793.062,36					
SAFRA CONSUMO AMERICANO	R\$ 6.132.936,65					
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.914.894,42	0,47%	3%	10%	10%	art. 8º, inciso III
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 852.519.275,17	14,91%				
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 5.716.136.897,92	100,80%				

Quadro 41.


 24

Relatório de Investimentos Novembro de 2019

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% CARTEIRA	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM I FIC FI	R\$ 252.406.254,66	4,37%	20%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 19.649.879,22	0,34%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 272.075.322,29	4,71%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 901.089.149,08	15,59%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 9.336.501,90	0,16%	
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 180.136.637,69	3,12%	
CAIXA FI BRASIL IRF M I TP RF	R\$ 258.181.054,65	4,47%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 776.796.264,83	13,44%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 86.964.406,93	1,50%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 44.537.083,42	0,77%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 51.949.827,85	0,90%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 42.401.252,65	0,73%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 261.917.736,18	4,53%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 103.294.286,96	1,79%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 100.778.316,11	1,74%	
BRADESCO INST IBR X ALPIA	R\$ 30.887.141,46	0,53%	
ITAU INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 267.819.534,54	4,63%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 331.464.238,65	5,74%	
SANTANDER IMA B INST. TP RF LP	R\$ 23.434.070,60	0,41%	
ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 63.942.188,09	1,11%	
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 138.000.778,68	2,39%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 4.978.959,41	0,09%	
ITAU INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 147.095.561,50	2,55%	
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 252.166.633,25	4,36%	
ICATU VANG. FI RF INFAÇÃO CP LP	R\$ 12.741.510,61	0,22%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 53.450.194,19	0,92%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 108.368.462,49	1,88%	
ICATU VANGUARDA AÇÕES IIX FI	R\$ 24.882.120,83	0,43%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 62.723.302,30	1,09%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 71.640.744,59	1,24%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 31.360.951,63	0,54%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 12.793.062,36	0,22%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO	R\$ 6.132.936,65	0,11%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 63.745.000,02	1,10%	
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.914.894,42	0,10%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO	R\$ 5.075.056.260,69		
TÍTULOS DO TN	R\$ 628.739.740,27		
IMÓVEIS	R\$ 62.060.000,00		
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1.160.103,68		
FCVS	R\$ 12.334.896,96		
TOTAL DO RECURSOS	R\$ 5.779.351.001,60		

Quadro 42.

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


 25

Relatório de Investimentos Novembro de 2019

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

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL DO FUNDO	Resolução CMN nº 3.922/2010	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 252.406.254,66	7.434.585.418,43	3,40%	15%	
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	R\$ 19.649.879,22	684.460.380,72	2,87%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 272.075.322,29	2.996.336.299,76	9,08%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 901.089.149,08	7.846.560.538,65	11,48%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 9.336.501,90	9.385.285.182,14	0,10%		
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 42.401.252,65	311.365.665,57	13,62%		
BRDESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 261.917.736,18	5.289.325.651,57	4,95%		
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 103.294.286,96	831.823.872,67	12,42%		
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 100.778.316,11	1.015.325.062,17	9,93%		
BRDESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 30.887.141,46	208.222.558,91	14,83%		
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF	R\$ 258.181.054,65	10.884.142.147,81	2,37%		
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 776.796.264,83	9.996.525.968,83	7,77%		
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 86.964.406,93	3.038.651.285,90	2,86%		
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 44.537.083,42	260.764.364,31	17,08%		
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 51.949.827,85	212.006.249,68	24,50%		
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 331.464.238,65	9.094.359.000,50	3,64%		
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 4.978.959,41	440.383.541,33	1,13%		
ITAU INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 267.819.534,54	5.189.532.772,55	5,16%		
ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 63.942.188,09	897.366.609,43	7,13%		
ITAU INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 147.095.561,50	2.239.240.686,39	6,57%		
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 138.000.778,68	3.818.759.953,49	3,61%		
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 180.136.637,69	1.298.833.749,12	13,87%		
SANTANDER IMA B INST. TP RF LP	R\$ 23.434.070,60	1.030.045.605,16	2,28%		
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 71.640.744,59	728.046.066,33	9,84%		
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 31.360.951,63	712.083.427,80	4,40%		
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 252.166.633,25	2.037.041.662,03	12,38%		
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 53.450.194,19	620.089.599,91	8,62%		
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 108.368.462,49	1.315.439.822,55	8,24%		
ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FI	R\$ 24.882.120,83	202.956.513,51	12,26%		
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 63.745.000,02	2.038.510.561,95	3,13%		
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 62.723.302,30	1.600.410.389,56	3,92%		
TOTAL	R\$ 5.037.473.856,65				

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14, § 1º	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Resolução CMN nº 3.922/2010
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.914.894,42	293.742.121,08	2,01%	5%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 12.793.062,36	370.626.417,47	3,45%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO	R\$ 6.132.936,65	575.084.073,69	1,07%	
ICATU VANG. FI RF INFAÇÃO CP LP	R\$ 12.741.510,61	539.431.050,15	2,36%	
TOTAL	R\$ 37.582.404,04			

TOTAL	R\$ 5.075.056.260,69
--------------	-----------------------------

Quadro 43.

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

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

[Assinatura]
26

Relatório de Investimentos Novembro de 2019

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

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

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA OUT/19) EM R\$ MI	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (NOVEMBRO/2019)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB DTVM S.A	R\$ 1.062.808,43	R\$ 1.454.557.107,15	0,1369%	5%
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 754.415,52	R\$ 616.858.062,81	0,0818%	
BRADESCO	R\$ 580.344,85	R\$ 539.278.733,36	0,0929%	
CAIXA	R\$ 375.350,84	R\$ 1.560.786.730,16	0,4158%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	R\$ 284.180,76	R\$ 306.572.404,51	0,1079%	
BANCO BTG	R\$ 106.387,10	R\$ 62.723.302,30	0,0590%	
BANCO SAFRA	R\$ 103.580,90	R\$ 82.670.999,03	0,0798%	
ICATU VANGUARDA DTVM S/A	R\$ 25.052,49	R\$ 451.608.921,37	1,8027%	

Quadro 44.

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

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

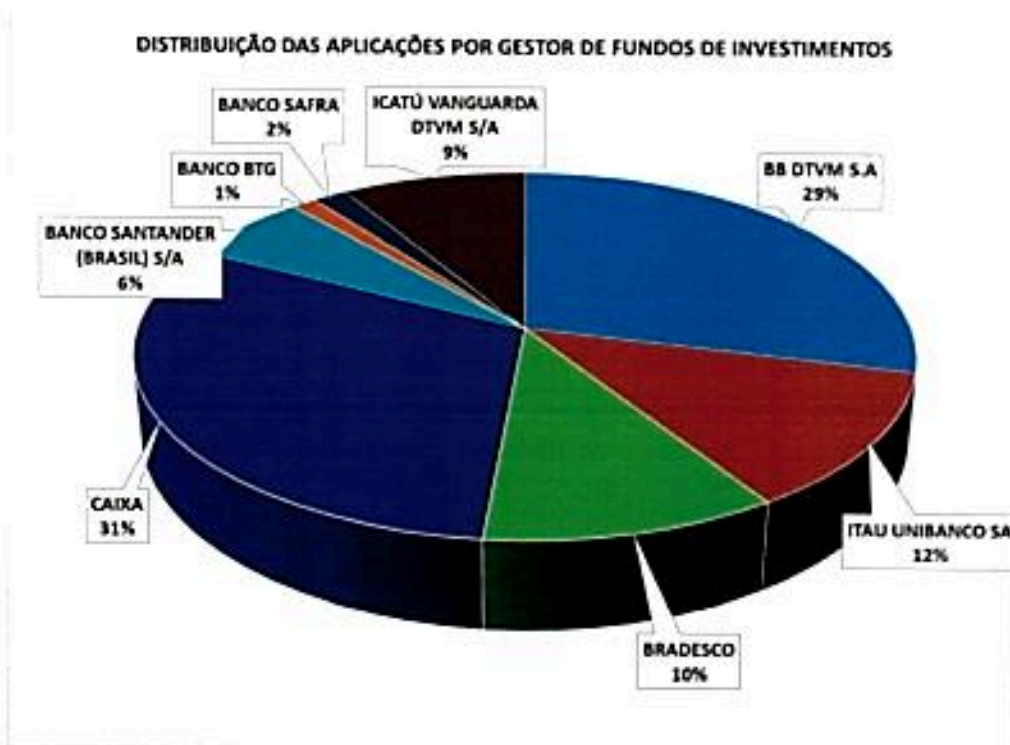


Gráfico 4.


 27

Relatório de Investimentos Novembro de 2019

13. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

FFREV PODER EXECUTIVO	SALDO
FUNDO DE INVESTIMENTO FFREV - EXECUTIVO	R\$ 4.267.285.984,58
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 626.610.381,96
TÍTULOS PÚBLICOS - CVS	R\$ 12.334.896,96
IMÓVEIS	R\$ 62.060.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EXECUTIVO	R\$ -
TOTAL	R\$ 4.968.291.263,50

ASSEMBLEIA LEGISLATIVA	SALDO
ALE FFREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 10.021.409,17
ALE FFREV TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.129.358,31
ALE FFREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
ALE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 377.517,95
ALE FFIN DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - ALE COBERTURA	R\$ -
TOTAL	R\$ 12.528.286,43

PROCURADORIA GERAL DE JUSTIÇA - PGJ/MPA	SALDO
MPE FFREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 139.436.201,11
MPE FFREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
MPE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 754.333,47
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - PGJ/MPA - FFIN	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - MPE COBERTURA	R\$ 187.418,23
TOTAL	R\$ 140.377.954,81

DEFENSORIA PÚBLICA - DPE/AM	SALDO
DPE FFREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 9.856.121,02
DPE FFREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
DPE - FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 291.170,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - DPE - FFIN	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - DPE COBERTURA	R\$ -
TOTAL	R\$ 10.147.291,02

TRIBUNAL DE JUSTIÇA - TJ/AM	SALDO
TEAM FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 390.517.920,47
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA	R\$ -
TEAM - FFREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 17.248.921,31
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA - FFREV	R\$ -
TOTAL	R\$ 407.766.841,78

TRIBUNAL DE CONTAS DO ESTADO - TCE/AM	SALDO
TCEAM FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 151.807.960,40
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TCE	R\$ 730.809,42
TCEAM - FFREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 3.260.451,82
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TCE/FFREV	R\$ -
TOTAL	R\$ 155.799.221,64

OUTROS RECURSOS	SALDO
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO EXECUTIVO	R\$ 43.628.747,48
DISP. FINANCEIRA - TAXA DE ADM. EXECUTIVO	R\$ 1,00
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - ALE	R\$ 758.006,64
DISP. FINANCEIRA - TX DE ADM. ALE	R\$ -
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO TCE	R\$ 256.257,43
DISP. FINANCEIRA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO TCE	R\$ -
FUNDO FINANCEIRO - EXECUTIVO	R\$ 35.646.812,27
FUNDO FINANCEIRO - COMPREV	R\$ 3.908.443,57
DISP. FINANCEIRA - FFIN EXECUTIVO	R\$ 770,00
DISP. FINANCEIRA - FFIN EXECUTIVO - COBERT DEFICIT	R\$ 33.489,10
DISP. FINANCEIRA - SAL. NÃO RECLAMADOS	R\$ 207.614,93
DISP. REPASSIS PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ -
TOTAL	R\$ 84.448.142,42
TOTAL GERAL	R\$ 5.779.351.001,40

Quadro 45.



Gráfico 5.

Nota: Conforme PPA 2019-2021 o valor projetado para 2019, equivale ao total de R\$ 5.271.918.303,00.

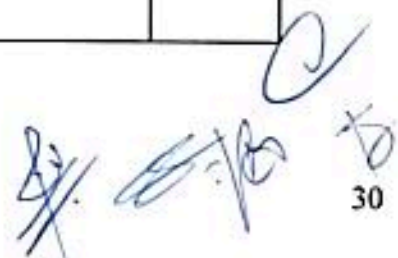
29

Relatório de Investimentos Novembro de 2019

15. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV EXECUTIVO:	a) Novos Recursos: As aplicações em fundos de Ações devem ser realizadas a partir de 2020, pois o limite estabelecido no PAI 2019, para Renda Variável, já foi atingido. Lembrando que a Estratégia para 2020 é alisar o limite máximo permitido na legislação. Assim, por ora, os novos recursos devem ser direcionados para fundos de Alocação do Bradesco, Caixa, BB, Itaú e Santander, sem prejuízo do enquadramento dos recursos, inclusive os que já estão disponíveis em conta corrente.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/01/2020
	b) Fundos de Curto Prazo: Manter, regularmente, saldo de aplicação no fundo Bradesco Masi Poder Público no valor de R\$ 2.000.000,00 (dois milhões de reais), já que possui taxa automática otimizando o processo de pagamentos de retira, incluindo filia de pagamento de aposentados e pensionistas do FPREV.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/01/2020
	c) Demais recursos: Migrar em janeiro/2019 R\$ 50 milhões do fundo BB Previdenciário (DKA 2 para o fundo BB Ações Valor FIC FIA (29.258.294.0001-38)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMEV	15/01/2020
	d) Migrar R\$ 50 milhões do fundo Bradesco DI Premium para o fundo Bradesco Alocação Dinâmica.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMEV	15/01/2020
	e) Migrar R\$ 100 milhões do fundo Bradesco DI Premium para o fundo Bradesco FI Ações Small Cap Plus (CNPJ: 06.988.623.0001-09)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/01/2020
FPREV ALE:	Novos Recursos: Focar entre os fundos Itaú Alocação Dinâmica, Caixa Gestão Estratégica e Icatu Vanguarda FI RF Inflação Crédito Privado. A estratégia busca obter resultados acima do CDI no Longo Prazo através da gestão ativa desses produtos, conforme sugerido pelos representantes da ALE, ficando para posterior decisão movimentação para fundos de ações. Os demais membros de Comitê manifestaram-se favoráveis a operação.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/01/2020
FPREV MPE/PGJ:	Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Alocação Dinâmica, visando obter resultados acima do CDI no Longo prazo.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/01/2020
FPREV - DPE/AM	Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Alocação Dinâmica, visando obter resultados acima do CDI no Longo prazo.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/01/2020
FPREV - TJ/AM	Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Institucional FIC FI RF IMA-B 5, em linha com os dados apresentados no Cenário e buscando resultados acima do índice no longo prazo, e cumprindo os termos da Política de Investimentos da Amazaprev.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/01/2020
FPREV - TCE/AM:	Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Institucional FIC FI RF IMA-B 5, em linha com os dados apresentados no Cenário de curto prazo, buscando resultados acima do índice no longo prazo, e cumprindo os termos da Política de Investimentos da Amazaprev.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/01/2020
Outros Repasses - TCE e TJAM:	a) Novos recursos: os novos recursos recebidos pelo TCE e TJAM, devem ser direcionados para o fundo Bradesco Masi Poder Público.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/01/2020
	b) Demais Recursos: Migrar R\$ 100 milhões aplicados nos fundos BB Previdenciário IRF M1 e Caixa FI Brasil IRF M1 para os fundos BB Previdenciário Alocação e FI Caixa Gestão Estratégica.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/01/2020
FFIN - EXECUTIVO, ALE, DPE e MPE:	Aplicar os recursos no fundo Bradesco Masi Poder Público, facilitando a operacionalização dos pagamentos das filias de retiros e pensionistas desses órgãos. Devem ser observados os limites para aplicação conforme legislação vigente.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/01/2020
RECURSOS COMPREV:	Manter os recursos aplicados no fundo Bradesco Alocação Dinâmica, de forma manter o enquadramento dos recursos da Amazaprev.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/01/2020
DISPONIBILIDADES DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	Os Novos Recursos repassados pelo Poder Executivo, devem ser aplicados no fundo Masi poder Público, direcionando o residual, se houver, para o Fundo Caixa Gestão Estratégica. Aos valores repassados pelos demais órgãos serão mantidas as aplicações atuais. Havendo necessidade, a GERAF/COFIN pode solicitar transferência de valores da Caixa para o Bradesco.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/01/2020
FATOS RELEVANTES 1.	FUNDO AZ QUEST SMALL, MID CAPS: Informado que o fundo fecha para captação, por esse motivo a aplicação autorizada pela Diretoria na Ata 157 COMIV não foi realizada. Mas, há possibilidade de abertura de Capacity para uma única aplicação. Assim, fica mantida a posição já aprovada pela Diretoria, considerando que o produto venha agregar resultados à Carteira da Amazaprev, considerando o Cenário prospectivo para o índice Small.	COMIV	15/01/2020
FATOS RELEVANTES 2.	APLICAÇÕES BANCO BTG. Os membros do Comitê observaram que todos os esclarecimentos apresentados pela instituição foram compreendidos pelos investidores e em nada prejudicaram os resultados dos produtos. Assim, fica a sugestão de retomada das aplicações direcionando o valor de R\$ 50 milhões para o fundo BTG Abscoto debitando da aplicação Itaú Alocação Dinâmica, a se realizar no mês de janeiro/2020.	COMIV	15/01/2020

Quadro 46.



Relatório de Investimentos Novembro de 2019

16. RELATÓRIO DE RISCO DOS ATIVOS

16.1 ACOMPANHAMENTO DOS RISCOS POR FUNDO DE INVESTIMENTOS

FUNDOS DE INVESTIMENTOS	VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE	DRAWDOWN	
	MÊS %	12 M %	MÊS %	12 M %	12 M %	MÊS %	12 M %
BB PREV RF IDKA 2	1,31%	1,46%	2,16%	2,44%	3,60711	-0,23%	-0,49%
BB PREVID IMA B 5+ TIT PUB RF	6,37%	7,07%	10,29%	11,72%	3,24231	-4,74%	-4,74%
BB PREVID RF IRFM 1 TP	0,23%	0,25%	0,39%	0,44%	2,41142	-0,03%	-0,03%
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC DE FI	1,85%	2,29%	3,01%	3,82%	3,17771	-1,21%	-1,22%
BB PREVID TIT PUB VII FI	0,84%	1,25%	1,40%	2,10%	3,75480	-0,15%	-0,52%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	1,84%	2,16%	2,99%	3,60%	3,16951	-1,20%	-1,20%
BRANCO FEDERAL EXTRA	0,01%	0,03%	0,03%	0,07%	-4,22996	0,00%	0,00%
BRANCO FI REFER DI PREMIUM	0,02%	0,04%	0,05%	0,00%	-1,80079	0,00%	0,00%
BRANCO FIC FIA INSTITUCIONAL	13,82%	17,56%	22,73%	28,97%	1,07136	-3,24%	-8,04%
BRANCO INST. FIC FI RF IMA B5	1,48%	2,01%	2,41%	3,36%	3,49814	-0,63%	-0,81%
BRANCO IRFM 1 TP	0,23%	0,25%	0,38%	0,43%	2,44072	-0,03%	-0,03%
BRANCO MAXI PD PÚBLICO	0,01%	0,03%	0,03%	0,07%	-7,71875	0,00%	0,00%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	15,13%	17,06%	24,88%	28,19%	1,61822	-3,60%	-7,45%
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	0,74%	3,87%	1,25%	6,38%	-0,75989	-1,16%	-2,72%
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	2,10%	4,97%	3,40%	8,22%	1,22201	-1,24%	-3,54%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF	1,43%	1,92%	2,32%	3,21%	3,64966	-0,57%	-0,71%
CAIXA FI BRASIL IMA B5+	6,50%	6,97%	10,50%	11,56%	3,26548	-4,81%	-4,81%
CAIXA FI BRASIL IRFM 1	0,23%	0,24%	0,39%	0,43%	2,75276	-0,03%	-0,03%
CAIXA FIA CONSUMO	15,79%	17,62%	26,11%	29,12%	2,10172	-5,29%	-10,18%
CAIXA GESTÃO ESTRATEGICA	1,60%	3,73%	2,61%	6,20%	3,01715	-0,81%	-2,73%
FIC CAIXA CAPITAL PROTEGIDO	3,98%	1,56%	6,67%	2,61%	3,06430	-0,36%	-0,36%
ICATU DIVIDENDOS FIA	11,58%	14,85%	19,07%	24,55%	1,99684	-2,09%	-6,99%
ICATU INFLAÇÃO CRÉDITO PRIVADO	1,57%	1,86%	2,53%	3,11%	3,34871	-1,05%	-1,05%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA	1,46%	1,96%	2,37%	3,27%	3,60505	-0,61%	-0,74%
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA	6,43%	7,02%	10,39%	11,65%	3,26727	-4,79%	-4,79%
ICATU VANGUARD AÇÕES IBIX FI	13,57%	17,82%	22,32%	29,41%	1,03653	-3,47%	-9,44%
ITAU AÇÕES PHOENIX FIC FI	14,74%	17,75%	24,36%	29,31%	1,43761	-4,53%	-9,05%
ITAU DUNAMIS FIC	12,34%	16,78%	20,37%	27,73%	1,68510	-2,52%	-9,59%
ITAU FOF RPI AÇÕES	13,67%	16,58%	22,52%	27,36%	1,13195	-3,04%	-9,09%
ITAU INSTIT ALOC DINÂMICA RF FIC	0,01%	2,09%	0,03%	3,48%	3,44745	0,00%	-1,15%
SAFRA CONSUMO AMERICANO	10,33%	14,07%	17,29%	23,24%	1,65905	-2,86%	-17,03%
SAFRA IMA INST. FI FIC RF	4,29%	5,36%	6,94%	8,90%	3,30543	-3,00%	-3,33%
SAFRA S&P REAIS PB MM	6,00%	14,09%	10,03%	23,24%	0,85283	-0,49%	-16,71%
SANTANDER AÇÕES TOP SELEÇÃO	13,43%	17,33%	22,11%	28,59%	1,02536	-2,85%	-7,65%
SANTANDER FIC FI IMA B	3,98%	4,70%	6,44%	7,82%	3,43822	-2,89%	-2,89%
SANTANDER FIC IMA-B 5 TIT PUB RF	1,40%	1,92%	2,29%	3,20%	3,65497	-0,53%	-0,71%
SANTANDER IBOVESPA AÇÕES	13,54%	17,58%	22,29%	29,01%	0,92609	-2,98%	-8,80%

RISCOS DA CARTEIRA AMAZONPREV

CARTEIRA AMAZONPREV	2,64%	2,46%	4,33%	4,10%	2,80209	-0,71%	-1,12%
---------------------	-------	-------	-------	-------	---------	--------	--------

Quadro 47.

Nota 1: VOLATILIDADE: Volatilidade é o nome que se dá ao Desvio Padrão dos retornos de um ativo. Dessa forma, a Volatilidade mede o quanto os retornos diários se afastam do retorno médio do período analisado. Assim sendo, uma Volatilidade alta representa maior risco, visto que os preços do ativo tendem a se afastar mais de seu valor médio.

Nota 2: VALUE at RISK (95%): Sintetiza a maior perda esperada para a Carteira no intervalo de um dia. Seu cálculo baseia-se na média e no desvio padrão dos retornos diários da Carteira, e supõe que estes seguem uma distribuição


 31

Relatório de Investimentos Novembro de 2019

normal. Dado o Desempenho da Carteira nos últimos 12 meses, estima-se com 95% de confiança que, se houver uma perda de um dia para o outro, o prejuízo médio da carteira será de 4,63%.

Nota 3: DRAWDOWN: Auxilia a determinar o risco de um investimento ao medir seu declínio desde o valor máximo alcançado pelo ativo, até o valor mínimo atingido em determinado período de tempo. Para determinar o percentual de queda, o Draw-Down é medido desde que a desvalorização começa até se atingir um novo ponto de máximo, garantindo, dessa forma, que a mínima da série representa a maior queda ocorrida no período. Quanto mais negativo o número, maior a perda ocorrida e, conseqüentemente, maior o risco do ativo. Já um Draw-Down igual a zero, indica que não houve desvalorização do ativo ao longo do período avaliado.

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



Relatório de Investimentos Novembro de 2019

VOLATILIDADE DA CARTEIRA COM BASE NA NOTA DE RISCO DO ADMINISTRADOR

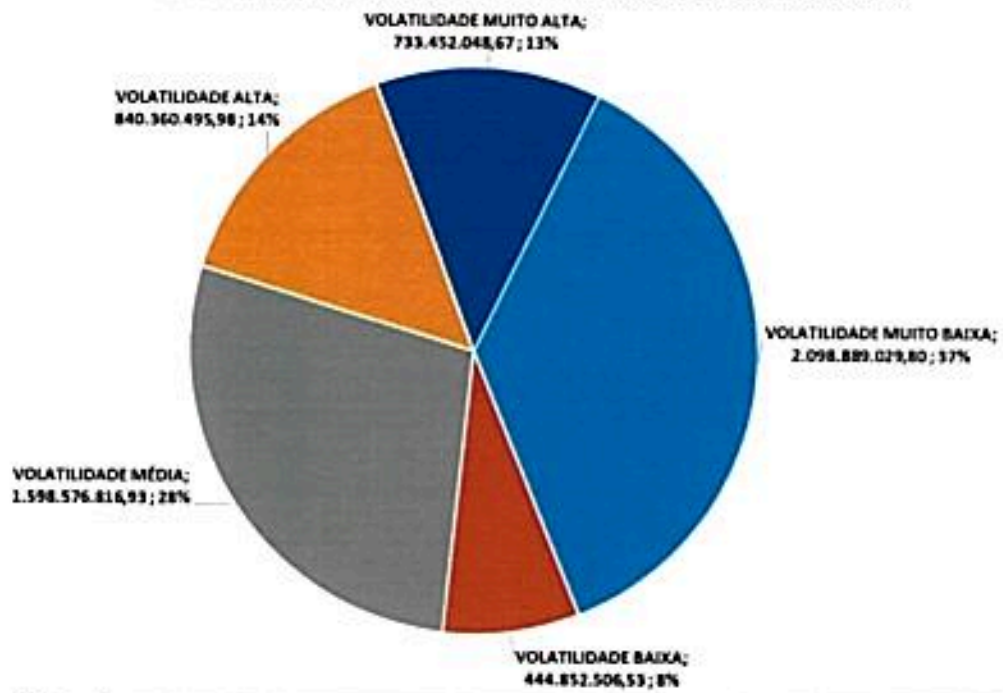


Gráfico 6.

Relatório de Investimentos Novembro de 2019

17. VERIFICAÇÃO DE LASTRO DOS FUNDOS DE RISCO DE CRÉDITO

CREDITORAÇÃO			
TABELA - DURATION & YIELD POR CLASSE			
Ativo	Duration	Yield	N.º
CBR	8,45	1,05%	58,1%
CR	0,00	0,00%	0,0%
LP	2,67	0,42%	11,0%
CDR	1,17	0,49%	1,0%
CPM	0,00	0,00%	0,0%
RF	0,00	0,00%	0,0%
FOC	0,00	0,00%	0,0%
NIN B	3,38	-	21,5%
Over	0,00	-	7,2%
Carteira Crédito	8,27	0,89%	71,9%
Crédito - Contribuição Fundo	8,77	0,86%	71,9%
Fundo (incluindo DAP e NTN-B)	2,79	0,86%	100,0%

TABELA - RATING EXTERNO*		
Rating	Exposições	N.º
AAA	112.292.108	20,8%
AA+	80.438.403	14,9%
AA	91.298.283	16,9%
AA-	26.548.022	4,9%
A+	18.446.864	3,4%
CPM	0	0,0%
A	11.811.694	2,2%
A-	14.017.205	2,6%
BBB+	14.851.510	2,7%
BBB	0	0,0%
BBB-	0	0,0%
BB+	15.262.060	2,8%
BB	0	0,0%
BB-	0	0,0%
B+	0	0,0%
B	0	0,0%
B-	0	0,0%
CCC	0	0,0%
CC	0	0,0%
C	0	0,0%
Sem Limite	0	0,0%
Totouro / Over	154.901.126	28,7%
Total	539.532.569	100,0%

TABELA - SETOR		
Setor	Exposições	N.º
Energia	112.292.087	20,8%
Bancos	71.528.124	13,3%
Saneamento	40.156.108	7,4%
Conc. Rodoviárias	37.551.909	6,9%
Serviço	25.891.819	4,7%
Óleo e Gas	15.807.084	2,9%
Shopping Center	15.425.174	2,8%
Holding	15.615.941	2,9%
Mineração e Siderurgia	15.187.862	2,8%
Consumo	14.648.038	2,7%
Varejo	10.520.406	1,9%
Infraestrutura	4.514.791	0,8%
Papel e Celulose	3.243.604	0,6%
Logística	3.013.432	0,6%
Totouro / Over	154.901.126	28,7%
Total	539.532.569	100,0%

TABELA - EMISSOR		
Empresa	Exposições	N.º
Eletrobras	20.042.198	3,7%
BR PARANAPANEMA ENERGIA	15.401.192	2,9%
CEMIG D	15.181.090	2,8%
NATURA	14.648.038	2,7%
Rota das Bandeiras	14.017.205	2,6%
COPASA	12.888.123	2,4%
Unif	12.587.943	2,3%
Usiminas	11.851.856	2,2%
SABESP	10.950.266	2,0%
Banco FIDIS	10.757.738	2,0%
LOJAS AMERICANAS	10.520.406	1,9%
LOCALIZA	10.382.177	1,9%
CCR AUTOBAN	10.028.271	1,9%
Smarfit	9.902.837	1,8%
Bridasul	9.152.802	1,7%
AES TETE	8.816.954	1,6%
Sanebas	8.348.889	1,5%
PETROBRAS	8.410.176	1,6%
Debrum	8.325.492	1,5%
TAESA	8.229.244	1,5%
Águas de Guaranés	7.958.850	1,5%
COMGÁS	7.396.909	1,4%
COPIS	7.858.472	1,4%
MULTIPLAN	7.199.901	1,3%
Sofisa	6.890.000	1,3%
AFB	5.758.800	1,1%
Saia	5.376.238	1,0%
Triângulo	5.307.718	1,0%
Itau	5.241.279	1,0%
Eneis	5.145.449	1,0%
Gerdau	4.514.791	0,8%
CCF	4.400.644	0,8%
REGIS BITENCOURT	4.385.148	0,8%
TERMOFERNAMBUCO	4.174.041	0,8%
BOOMAS	3.956.773	0,7%
EQUATORIAL	3.779.078	0,7%
BNB	3.708.677	0,7%
Dea	3.551.913	0,7%
CPFL GERAÇÃO	3.509.476	0,7%
Valeparagem	3.356.598	0,6%
VALE	3.336.306	0,6%
Suzano	3.243.604	0,6%
Caixa	3.225.188	0,6%
Rauis	3.017.967	0,6%
MRS LOGÍSTICA	3.013.432	0,6%
Distoparcel	3.010.375	0,6%
ABC Brasil	2.820.724	0,5%
ECORODONIAS	2.794.475	0,5%
ENEL BR	2.708.015	0,5%
Santa Antônia Energia	2.470.443	0,5%
ENEL CEASA	2.404.851	0,4%
ECOPISTAS	2.161.588	0,4%
Barrisul	2.103.333	0,4%
EDP SAO PAULO	1.940.498	0,4%
Caixa	1.818.158	0,3%
BRMALLS	1.725.080	0,3%
Unidas	1.554.706	0,3%
EDP ESPÍRITO SANTO	1.435.612	0,3%
CPFL RGE	1.411.068	0,3%
SONAE SERRA	1.296.091	0,2%
CPFL Piracicaba	1.211.858	0,2%
QUATIM	1.008.458	0,2%
COELBA	808.126	0,2%
Vibrantes	882.068	0,2%
Totouro / Over	154.901.126	28,7%
Total	539.532.569	100,0%

Quadro 49.

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

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

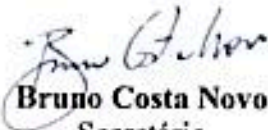
O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 16 de dezembro de 2019, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de Novembro/2019, com o acompanhamento da Rentabilidade e Risco das diversas modalidades de operações realizadas nas aplicações dos recursos do RPPS.

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

Todas as operações efetuadas foram analisadas pelo Controles Internos, e, posteriormente, aprovadas pela Diretoria dessa Fundação Amazonprev. Estão integralmente enquadradas aos limites estabelecidos pela Resolução CMN nº. 3.922/2010 e suas alterações, e descritas no item 15. Plano de Ação Mensal e registradas em Ata de Reunião Ordinária do Comitê.


Manaus – AM, 16 de dezembro de 2019.


Alan Nascimento
Coordenador


Bruno Costa Novo
Secretário


Bruno Barroso
Membro


Leonardo Cavalcanti
Membro


Marcos Souza
Membro

FÉRIAS
Renizio Ferreira
Membro

APROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL - COFIS

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

APROVAÇÃO

REJEIÇÃO

Data:

Membros do Conselho Fiscal: