



GÓVERNO DO ESTADO DO AMAZONAS



AMAZONPREV

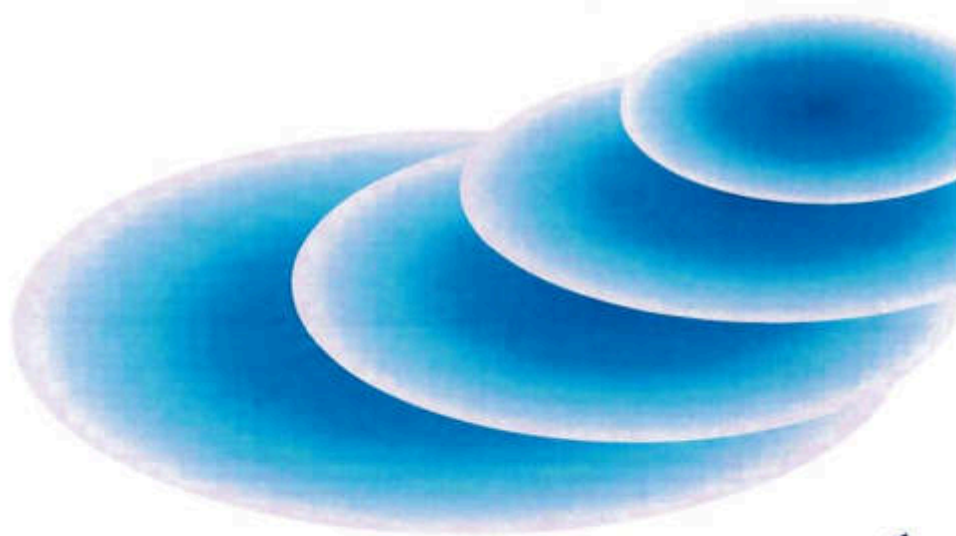
Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



RELATÓRIOS - 2019

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Outubro / 2019



Relatório de Investimentos Outubro de 2019

Destino: DIRAF / PRESI

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

Data: 12/11/2019

RELATÓRIO Nº. 053/2019 – COMIV

Senhores Diretores,

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



1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

A partir do Relatório Conjuntura Macroeconômica, emitido pela BB DTVM S/A Gestão de Recursos, registram-se os fatos:

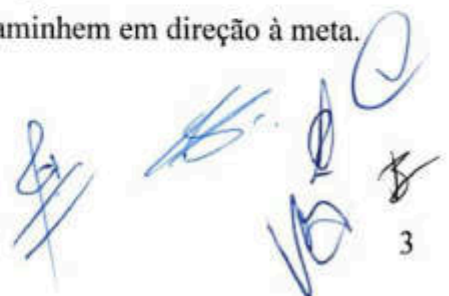
O mês de outubro revelou-se um período positivo no âmbito dos mercados. As notícias mais favoráveis em relação aos riscos geopolíticos – em particular, o avanço das negociações comerciais entre EUA e China e a diminuição do risco de um desfecho disruptivo para o Brexit, com a postergação para 31 de janeiro da data de saída do Reino Unido da União Europeia – e a continuidade dos movimentos de flexibilização monetária ao redor do globo foram os principais vetores a favorecer os preços dos ativos. Pelo lado negativo, a agenda de atividade econômica continuou a mostrar fragilidade, mantendo os receios entre analistas e investidores em relação à desaceleração global.

Nos EUA, a agenda seguiu mostrando moderação. As vendas ao varejo (após sete meses em alta) e a produção industrial (impactada greve dos trabalhadores da GM) caíram. Já os surveys regionais da indústria trouxeram resultados mistos, ao passo que os dados do setor imobiliário apontaram para um desempenho mais favorável. Por sua vez, as confianças seguiram em modesta recuperação. No entanto, o componente de emprego das prévias dos PMIs e os dados de investimento sinalizaram fraqueza. O relatório de emprego de setembro (payroll) mostrou-se sólido, com geração de 136 mil vagas e revisão altista de dados anteriores. Pelo lado da inflação, o núcleo do CPI mostrou em setembro alta de 0,13%, recuo de 2,39% para 2,36% na variação anual.

Na Zona do Euro, a divulgação da 1ª prévia do PIB do 3º tri (0,2%) revelou que a economia seguiu crescendo em ritmo lento. Entre as pesquisas de atividade, o PMI industrial ficou estável em 45,7 em outubro, enquanto o PMI de serviços aumentou de 51,6 em setembro para 51,8 em outubro.

Entre os emergentes, na China os dados foram mistos. Os PMI's mostram sinais divergentes: o oficial cedeu de 49,8 para 49,3 em outubro, enquanto o Markit/Caixin subiu de 51,4 para 51,7. Por fim, o PIB do 3º tri desacelerou para 6,0% (de 6,2%), mas os indicadores de setembro apresentaram melhora, sobretudo a indústria, que subiu 5,8%.

No âmbito dos Bancos Centrais, o FED (Banco Central dos EUA), reduziu pela terceira vez os juros (para o intervalo entre 1,50% e 1,75%) e deu por concluída a estratégia de cortes preventivos. Ao mesmo tempo, sinalizou que uma eventual elevação só deve ocorrer quando a inflação ganhar tração. Por sua vez, o Banco Central Europeu (BCE) manteve inalterada a taxa de depósitos em -0,50% e a orientação da política monetária, esperando que as taxas de juros se mantenham nos níveis atuais ou inferiores, até observar que as perspectivas de inflação caminhem em direção à meta.



3

Relatório de Investimentos Outubro de 2019

No ambiente doméstico, os dados de atividade continuaram retratando recuperação gradual da economia. As vendas no varejo de agosto ficaram praticamente estáveis em relação a julho, tanto na leitura restrita (+0,1%) quanto na ampliada (0,0%), com ajuste sazonal. Na comparação anual, o índice restrito avançou 1,3%, ao passo que o ampliado subiu 1,4%. Por sua vez, a indústria surpreendeu ao avançar 0,8% em agosto, puxada pela forte alta da extrativa (+6,6%). No campo inflacionário, o IPCA-15 avançou 0,09% em relação ao mês anterior e passou a acumular alta de 2,72% em doze meses, a menor desde outubro/17. Pelo lado do emprego, o Caged apontou 157 mil novos postos de trabalho em setembro. No front fiscal, o setor público consolidado registrou déficit primário de R\$20,5 bilhões em setembro. No setor externo, o déficit em transações correntes totalizou US\$3,5 bilhões em setembro, acumulando em 12 meses US\$37,4 bilhões (2,05% do PIB). Por fim, o Copom cortou a SELIC em 0,50p.p. para 5,0%, mas com um comunicado mais conservador que o esperado.

BOLSA

A Bolsa de Valores de São Paulo encerrou o mês de outubro com alta de 2,36%, aos 107.219 pontos. No ano, o índice Ibovespa acumula ganhos de 22%. Já em 12 meses, a alta é de 22,64%. O desempenho da bolsa doméstica foi no mesmo sentido das principais bolsas dos países desenvolvidos e da maior parte dos emergentes.

No exterior, o ambiente para os ativos de risco foi satisfatório. Pelo lado positivo, colaboraram para o desempenho dos mercados: os sinais de avanço num acordo parcial entre EUA e China em torno da disputa comercial entre os dois países; resultados corporativos do 3º trimestre preponderantemente positivos nos EUA, especialmente de bancos e indústrias; as sinalizações por parte dos diretores do FED que não afastaram as chances de novo corte de juros, concretizado ao fim do mês; a agenda de atividade mista, mas em patamar sólido, nos EUA, o que contribuiu para continuar afastando os temores de recessão; e, por fim, a aprovação do adiamento do Brexit para 31 de janeiro de 2020 pela União Europeia, reduzindo as chances de uma saída desordenada do país do bloco. Esse ambiente favoreceu a redução da aversão ao risco – o VIX fechou o mês em queda de 3 pontos, para 13,2 – e o desempenho favorável dos mercados de risco: o índice S&P500 fechou em alta de 2,04% e o europeu Stoxx 50 subiu 0,35%. Entre os emergentes, o índice MSCI encerrou o mês com ganhos de 4,09%.

Internamente, os mercados se beneficiaram do noticiário político positivo em torno da aprovação da Reforma da Previdência no Senado. Além disso, a perspectiva de intensificação dos estímulos monetária por parte do Copom também acabou se refletindo positivamente no mercado acionário, a



Handwritten signatures and initials in blue ink at the bottom right of the page.

Relatório de Investimentos Outubro de 2019

despeito dos sinais de uma ainda lenta retomada do crescimento econômico doméstico. Nesse ambiente, o prêmio de risco Brasil (Embi+) encerrou o mês em queda ante setembro, aos 240 pontos.

CÂMBIO

O Real encerrou o mês de outubro com importante valorização de 3,85% ante o Dólar, a R\$4,00. No ano, a moeda doméstica exibe depreciação de 3,34%. Já em 12 meses, a moeda doméstica encontra-se desvalorizada em 7,70%.

No exterior, a divisa americana apresentou perda ante as principais moedas internacionais, influenciada pelo ambiente de menor aversão ao risco. Entre os fatores que levaram o Dólar a perder globalmente estiveram: os sinais de avanços na disputa comercial entre EUA e China; e a política monetária flexível por parte do banco central dos EUA (FED), que cortou os juros durante o mês. Além disso, a aprovação do adiamento do Brexit para 31 de janeiro de 2020 colaborou para o fortalecimento do Euro ante o Dólar, apesar da fraca agenda macro europeia limitar o avanço. O índice DXY, que mede o desempenho do Dólar ante uma cesta de moedas de países desenvolvidos, encerrou o mês com recuo de 2,04%. No mesmo período, uma cesta de moedas emergentes apontou uma valorização de 0,4% ante o dólar.

Além dos fatores globais já citados, elementos domésticos parecem ter colaborado para a valorização da moeda brasileira. Entre eles, a aprovação definitiva da Reforma da Previdência no Senado, evento que tende a favorecer a retomada da atividade e reduzir os prêmios de risco; e a perspectiva de maior fluxo de dólares para o país a partir dos leilões da cessão onerosa, que deve ocorrer na primeira semana de novembro.

JUROS

As taxas de juros encerraram o mês de outubro com importante queda em todos os segmentos da estrutura a termo doméstica.

Em relação à parte curta da curva, o movimento refletiu basicamente a decisão do Copom, que cortou a Selic em 0,50p.p., para 5,00% e sinalizou mais um corte adicional na reunião de dezembro. Apesar disso, o comunicado foi mais conservador que o esperado pelo mercado, trazendo alteração na orientação futura da política monetária – maior cautela para os movimentos ao longo de 2020 – e inclusão de novos elementos no balanço de riscos para a inflação. Além da política monetária, o movimento de fechamento recebeu suporte dos dados de inflação, que seguiram sugerindo um ambiente inflacionário bastante benigno.

No segmento médio/longo, apesar de alguns riscos no âmbito externo, o cenário internacional foi em sua maior parte positivo, com a continuidade do movimento de flexibilização monetária global,



Relatório de Investimentos Outubro de 2019

o que trouxe alguma contribuição para o fechamento no Brasil. Internamente, colaboraram para o movimento, além do quadro esperado para taxa Selic e inflação nos próximos anos, a aprovação definitiva da Reforma da Previdência no Senado, a gradual recuperação da atividade doméstica e a queda do prêmio de risco país.

Entre os contratos futuros de juros mais negociados na BM&F, o contrato com vencimento em janeiro de 2020 encerrou o último dia do mês com taxa de 4,76% (de 5,07% do mês anterior); o vencimento janeiro/2021 projetava 4,50% (de 4,96%); o vencimento janeiro/2023 encerrou com taxa de 5,41% (de 6,06% no último dia do mês anterior); e o vencimento janeiro/2025 encerrou com taxa de 6,04% (de 6,68%).



6

Relatório de Investimentos Outubro 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 (%)				
	30/09/2019	31/10/2019	ago/19	set/19	out/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 318.066.367,33	R\$ 269.395.263,47	0,4974	0,4569	0,4576	1,4185%	5,0948%	6,1178%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 72.766.706,62	R\$ 73.994.307,83	0,0100	1,7580	1,6870	3,4850%	11,9835%	13,6801%
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 167.476,12	R\$ 2.048.285,69	0,4791	0,4429	0,4560	1,3843%	4,5103%	NC
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF	R\$ 43.831.701,83	R\$ 44.154.717,62	0,2328	0,6990	0,7369	1,6772%	6,8710%	7,9652%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 51.244.218,37	R\$ 52.467.611,49	0,0442	2,1943	2,3896	4,6827%	16,9546%	19,1636%
CAIXA FIC BRASIL G ESTRATÉGICA	R\$ 281.979.447,33	R\$ 286.802.290,79	(0,1295)	2,1183	1,7103	3,7303%	16,3334%	18,3177%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 766.851.279,69	R\$ 779.421.554,14	0,0349	1,7201	1,6392	3,4236%	11,8868%	13,5820%
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 86.712.964,19	R\$ 90.740.854,56	(0,7875)	3,6880	4,6450	7,6498%	31,9942%	NC
SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	R\$ 177.778.244,28	R\$ 180.680.849,67	0,0310	1,7211	1,6327	3,4140%	11,8775%	13,5257%
SANTANDER IMA B INST. TP	R\$ 23.252.720,99	R\$ 24.029.226,34	(0,4304)	2,8447	3,3394	5,8217%	7,8106%	NC
BB PREVID TP VII	R\$ 19.362.325,25	R\$ 19.565.023,97	0,1736	1,0808	1,0468	2,3163%	8,9835%	10,4338%
BB PREVID TP IX	R\$ 9.354.554,84	R\$ -	0,4824	0,4421	0,4570	1,3879%	4,9354%	5,9262%
BB PREVID IDKA 2	R\$ 808.698.650,13	R\$ 818.716.457,17	0,0523	1,4123	1,2387	2,7222%	9,7069%	11,1687%
BB PREVID RF IMA B5+	R\$ 258.441.015,75	R\$ 270.493.184,55	(0,7892)	3,7075	4,6634	7,6871%	32,0222%	NC
BB PREVID ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ -	R\$ 9.424.909,16	-	-	0,4570	0,4570%	0,4570%	NC
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 310.833.010,81	R\$ 262.298.618,23	0,3169	0,7827	0,4963	1,6038%	11,1450%	13,6467%
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 12.546.121,87	R\$ 12.733.501,77	0,1161	1,6124	1,4935	3,2497%	8,1774%	NC
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 52.767.734,59	R\$ 53.648.843,22	0,0177	1,7443	1,6697	3,4615%	7,2976%	NC
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 107.965.672,22	R\$ 113.049.579,80	(0,8050)	3,7348	4,7088	7,7450%	19,8066%	NC
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 63.154.195,44	R\$ 65.379.080,80	(0,4751)	2,9703	3,5229	6,0914%	7,2023%	NC
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 3.465.774.407,65	R\$ 3.429.044.160,27						

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)				
	30/09/2019	31/10/2019	ago/19	set/19	out/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPH	R\$ 20.704.271,77	R\$ 21.251.851,05	0,7118	2,7897	2,6447	6,2592%	6,2592%	NC
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO	R\$ 5.595.162,17	R\$ 5.768.219,69	0,3982	0,3876	3,0929	3,9046%	7,1758%	8,7156%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 4.904.650,32	R\$ 4.819.504,01	4,3822	2,5056	1,7360	8,8552%	43,9279%	48,1018%
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 69.346.004,82	R\$ 70.668.017,83	1,2356	2,0395	1,9064	5,2902%	21,6119%	24,7737%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 30.178.333,54	R\$ 30.898.851,94	0,2206	2,7953	2,3875	5,4817%	6,5477%	NC
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 61.368.682,30	R\$ 63.121.490,14	0,2323	2,0406	2,8561	5,1987%	23,1353%	26,9745%
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 75.947.679,72	R\$ 142.812.566,60	1,5778	(0,4754)	0,8985	2,0033%	23,1905%	31,4030%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 132.275.002,82	R\$ 135.427.389,51	1,5655	3,4230	2,3832	7,5454%	23,9280%	NC
SAFRA S&P REAIS	R\$ 12.071.225,59	R\$ 12.326.518,71	(1,4524)	2,1741	2,1148	2,8195%	23,9150%	14,8509%
SAFRA CONSUMO AMERICANO	R\$ 5.801.697,45	R\$ 5.756.005,34	5,8659	0,6160	(0,7875)	5,6791%	7,9859%	NC
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 173.962.217,83	R\$ 244.443.297,07	1,4665	2,6375	1,8671	6,0871%	32,0504%	NC
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 61.139.090,60	R\$ 62.570.039,57	1,9263	1,2517	2,3404	5,6174%	29,5720%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 653.294.018,93	R\$ 799.863.751,46						
TOTAL GERAL	R\$ 4.119.068.426,58	R\$ 4.228.907.911,73						

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 Vanguarda Dividendos FIA conforme registrado na Ata 155/2019 COMIV e aprovado pela Diretoria em Despacho de 09/10/2019.

Nota 3: O fundo BB Previd TP IX foi resgatado, após cumprido o período de carência e aplicado no fundo BB Previdenciário Alocação Ativa.

Nota 4: Os fundos Icatu Vanguarda Dividendos e Itaú Ações Dunamis, conforme comunicado pelas instituições, fecharam para captação nesse mês.

Relatório de Investimentos Outubro de 2019

2.2 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXECUTIVO

INSTITUIÇÃO	ago/19	set/19	out/19
BRADESCO	R\$ 410.650.990,98	R\$ 411.704.821,84	R\$ 366.689.708,04
BANCO DO BRASIL	R\$ 1.075.106.981,34	R\$ 1.095.856.545,97	R\$ 1.118.199.574,85
CAIXA	R\$ 1.217.672.053,24	R\$ 1.241.119.423,90	R\$ 1.264.174.752,30
ITAÚ	R\$ 552.126.352,15	R\$ 580.424.375,65	R\$ 603.660.064,48
SANTANDER	R\$ 294.684.165,86	R\$ 300.555.303,63	R\$ 306.276.945,78
ICATU/BEM DTVM	R\$ 317.243.727,08	R\$ 347.241.746,51	R\$ 423.875.221,86
SAFRA	R\$ 78.912.980,05	R\$ 81.027.118,48	R\$ 83.461.604,85
BTG PACTUAL	R\$ 60.383.291,70	R\$ 61.139.090,60	R\$ 62.570.039,57
TOTAL	R\$ 4.006.780.542,40	R\$ 4.119.068.426,58	R\$ 4.228.907.911,73

Quadro 2.

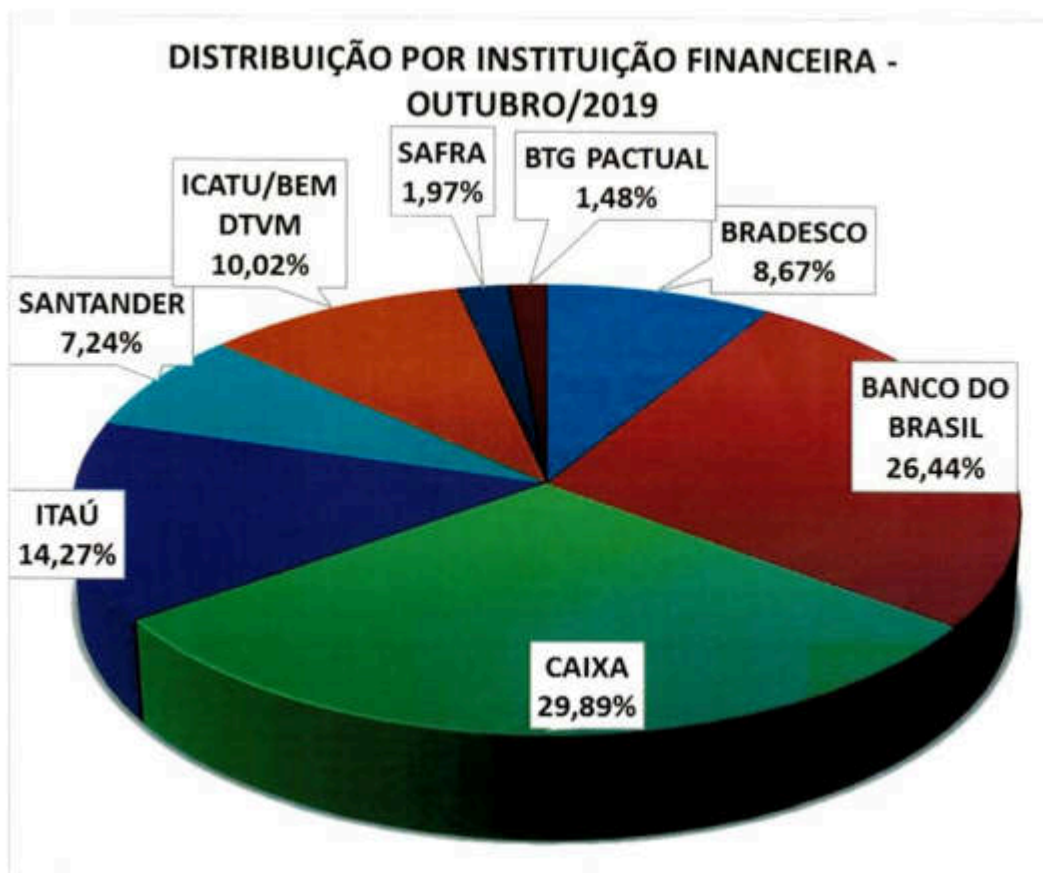


Gráfico 1

(Handwritten signatures and initials)

Relatório de Investimentos Outubro 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\$ 271.443.549,16	6,42%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA BB PREVID ALOCAÇÃO ATIVA SAFRA CONSUMO AMERICANO SAFRA S&P REAIS ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC FI	CDI ATIVO	R\$ 576.608.342,23	13,63%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF SANTANDER IMA B INST. TP	IMA B	R\$ 89.408.307,14	2,11%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5 CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP ICATU VANG. FIRF INFLA. CP ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	IMA B 5	R\$ 1.100.479.056,63	26,02%
BB PREVID IDKA 2 TP RF	IDKA 2	R\$ 818.716.457,17	19,36%
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF BB PREVID RF IMA B5+	IMA B 5+	R\$ 474.283.618,91	11,22%
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\$ 116.187.353,08	2,75%
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPH	IBR X	R\$ 21.251.851,05	0,50%
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO CAIXA CONSUMO FI AÇÕES ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA BTG ABSOLUTO FIQ FIA ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	IBOVESPA	R\$ 760.529.376,36	17,98%
TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO		R\$ 4.228.907.911,73	100%

Quadro 3

DISTRIBUIÇÃO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA - AMAZONPREV

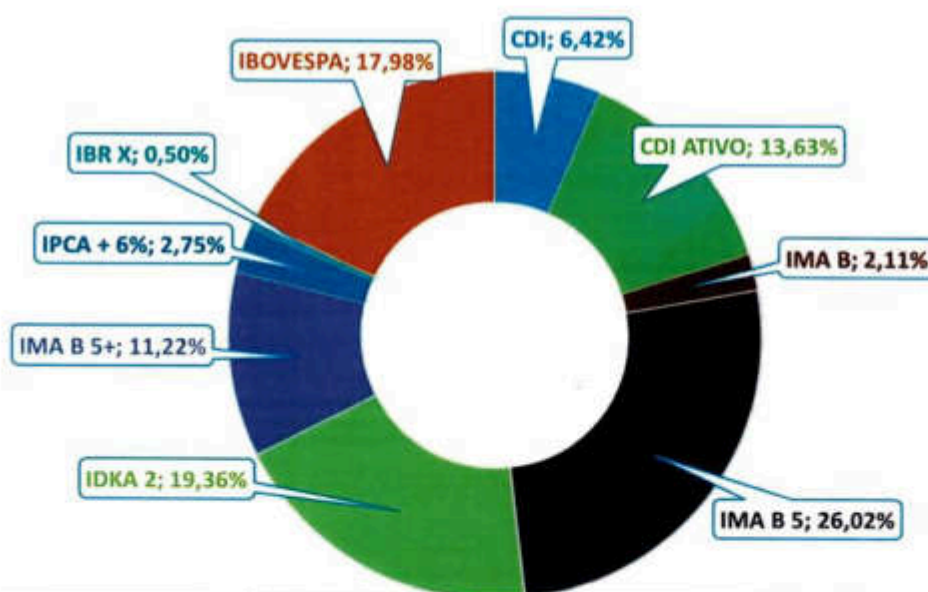


Gráfico 2.



Relatório de Investimentos Outubro de 2019

2.4 COMPARATIVO DA VALORIZAÇÃO DOS ÍNDICES DE REFERÊNCIA DE MERCADO

ÍNDICE	out/19	2019	12 MESES
CDI	0,4800%	5,1700%	6,2100%
IMA-B 5	1,6520%	12,0898%	13,7799%
IMA-B	3,3627%	23,5660%	26,7401%
IMA B 5+	4,6661%	32,4534%	36,9967%
IRF M 1	0,6245%	5,9628%	7,1330%
IDKA 2	1,2308%	10,4774%	12,0570%
IBOVESPA	2,3600%	22,0000%	22,6400%

Quadro 4.



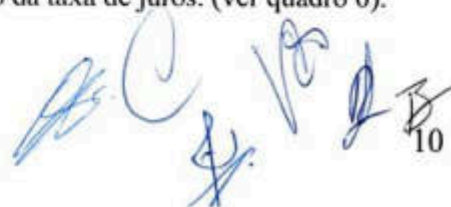
Gráfico 3.

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/09/2019	31/10/2019	ago/19	set/19	out/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 151.579.121,74	R\$ 152.526.674,22	0,635173	0,484386	0,625121	1,7548%	8,1080%	9,1793%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 153.345.716,47	R\$ 154.318.772,08	0,644604	0,493803	0,634550	1,7834%	8,2093%	9,3021%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 156.437.610,93	R\$ 157.467.184,05	0,668192	0,517356	0,658137	1,8550%	8,4632%	9,6099%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 158.862.847,59	R\$ 159.870.937,17	0,644619	0,493818	0,634566	1,7834%	8,2095%	9,3023%
TOTAL GERAL	R\$ 620.225.296,73	R\$ 624.183.567,52						

Quadro 5.

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


 10

Relatório de Investimentos Outubro 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\$ 152.526.674,22	R\$ 154.318.772,08	R\$ 157.467.184,05	R\$ 159.870.937,17
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	
	30/09/2019	31/10/2019
CVS - A	R\$ 1.519.252,58	R\$ 1.501.799,26
CVS - B	R\$ 9.830.669,50	R\$ 9.717.691,70
CVS - C	R\$ 197.080,52	R\$ 194.816,44
CVS - D	R\$ 1.078.063,80	R\$ 1.065.674,28
TOTAL	R\$ 12.625.066,40	R\$ 12.479.981,68

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
TOTAL	R\$ 384.365,47	R\$ 1.450.847,20	R\$ 1.835.212,67

Quadro 8.

Relatório de Investimentos Outubro de 2019

2.9 CONTROLE DE RECEBIMENTO DE ALUGUEIS

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
TOTAL	R\$ 558.937,63	R\$ 1.070.553,60	R\$ 1.629.491,23

Quadro 9.

2.10 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	30/09/2019	30/10/2019	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.119.068.426,58	R\$ 4.228.907.911,73	85,82%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 620.225.296,73	R\$ 624.183.567,52	12,67%
TÍTULOS CVS	R\$ 12.625.066,40	R\$ 12.479.981,68	0,25%
IMÓVEIS	R\$ 62.060.000,00	R\$ 62.060.000,00	1,26%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 423.077,31	R\$ 1,00	0,00%
TOTAL	R\$ 4.814.401.867,02	R\$ 4.927.631.461,93	100%

Quadro 10.

2.11 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

Mês	Recursos FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
out/18	R\$ 3.892.701.887,62	2,55%	16,21%	19,68%
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%

Quadro 11.

Relatório de Investimentos Outubro de 2019

2.12 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo do Amazonas - EXECUTIVO2019

08/11/2019 15:36:20

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 31/10/2019	
		Saldo Financeiro em 31/10/2018	3.892.701.887,62
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
11/2018	33.737.821,09	1.464.475,87	32.273.345,22
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
		Saldo Financeiro em 31/10/2019	4.927.631.461,93

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	2,5350 %	2,5969 %	0,1000 %
Juros	6,0000 %	4,9756 %	0,4868 %
Meta	8,6871 %	7,7017 %	0,5872 %
Rentabilidade	13,8855 %	12,2722 %	1,5453 %
Resultado %	4,7829 %	4,2437 %	0,9524 %
Resultado R\$	213.312.012,11	191.992.350,78	46.122.496,52

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).

RESUMO DA RENTABILIDADE - FPREV EXECUTIVO - 2019					
Mês	Receitas	Despesas	Saldo	Total dos Recursos	Ganhos Financeiros
jan/19	25.741.140,15	1.624.312,33	24.116.827,82	4.144.928.828,18	68.589.035,55
fev/19	36.105.221,68	1.577.166,50	34.528.055,18	4.198.622.173,30	19.165.289,94
mar/19	48.780.707,02	1.653.421,67	47.127.285,35	4.270.610.204,33	24.860.745,68
abr/19	27.254.847,98	1.484.969,43	25.769.878,55	4.340.813.251,38	44.433.168,50
mai/19	37.682.513,87	1.872.658,21	35.809.855,66	4.441.433.234,66	64.810.127,62
jun/19	41.150.382,45	1.842.441,88	39.307.940,57	4.560.478.660,06	79.737.484,82
jul/19	38.725.793,39	2.036.530,69	36.689.262,70	4.650.607.110,06	53.439.187,30
ago/19	39.885.991,44	1.920.723,93	37.965.267,51	4.698.765.985,21	10.193.607,64
set/19	41.301.229,85	1.811.278,88	39.489.950,97	4.814.401.867,02	76.145.930,84
out/19	40.858.104,23	2.023.186,58	38.834.917,65	4.927.631.461,93	74.394.677,25
Meta	7,7017%				515.769.255,15
Rentabilidade	12,2722%				
Resultado	4,2437%				

Quadro 13.

Relatório de Investimentos Outubro de 2019

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	30/09/2019	31/10/2019	ago/19	set/19	out/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 4.632.008,69	R\$ 4.767.453,02	(0,1295)	2,1183	1,7103	3,7303%	16,3333%	18,3177%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 4.511.804,65	R\$ 4.590.232,64	0,3169	0,7827	0,4963	1,6038%	6,1797%	NC
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 536.618,60	R\$ 552.660,23	-	1,2468	1,8671	3,1372%	3,1372%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 20,30	R\$ -						
TOTAL	R\$ 9.680.452,24	R\$ 9.910.345,89						

Quadro 14.

Nota: Conforme Ata 155/2019-COMIV, a Diretoria aprovou direcionar 5% (cinco por cento) dos valores aplicados nos fundos Caixa e Itaú, para o fundo Icatu Vanguarda Dividendos FIA, bem como, para os novos recursos.

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/09/2019	31/10/2019	ago/19	set/19	out/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.094.012,80	R\$ 2.107.300,36	0,644604	0,493803	0,634550	1,7834%	8,2093%	9,3021%
TOTAL GERAL	R\$ 2.094.012,80	R\$ 2.107.300,36						

Quadro 15.

3.3 Composição dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS - ALE FPREV	ago/19	set/19	out/19
SALDO ANTERIOR	11.373.542,16	11.456.007,59	11.774.465,04
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	116.326,93	115.124,97	117.675,84
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	(33.861,51)	203.332,48	125.505,37
SAÍDAS FINANCEIRAS	-	-	-
SALDO FINAL	11.456.007,59	11.774.465,04	12.017.646,25

Quadro 16.

3.4 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	30/09/2019	31/10/2019
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 9.680.431,94	R\$ 9.910.345,89
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.094.012,80	R\$ 2.107.300,36
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 20,30	R\$ -
TOTAL	R\$ 11.774.465,04	R\$ 12.017.646,25

Quadro 17.

Relatório de Investimentos Outubro de 2019

3.5 Evolução dos Recursos – ALE/FPREV

Mês	Recursos ALE FPREV		Evolução		
			Mensal	Anual	12 Meses
out/18	R\$	9.012.136,46	0,22%	18,98%	22,63%
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%

Quadro 18.

3.6 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo do Amazonas - ASSEMBLEIA2019

08/11/2019 15:31:28

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 31/10/2019		
		Saldo Financeiro em 31/10/2018		9.012.136,46
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$	
11/2018	143.781,95	0,00	143.781,95	
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	
		Saldo Financeiro em 31/10/2019		12.017.646,25
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	2,5350 %	2,5969 %	0,1000 %	
Juros	6,0000 %	4,9756 %	0,4868 %	
Meta	8,6871 %	7,7017 %	0,5872 %	
Rentabilidade	13,5288 %	11,8595 %	1,1543 %	
Resultado %	4,4547 %	3,8605 %	0,5638 %	
Resultado R\$	479.860,27	425.031,99	66.710,69	

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 Outubro de 2019

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/09/2019	31/10/2019	ago/19	set/19	out/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 40.869.902,67	R\$ 45.307.967,95	0,1041	1,4811	1,9081	3,5251%	9,1734%	NC	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+	R\$ 12.632.401,25	R\$ 13.221.502,14	(0,7892)	3,7075	4,6634	7,6871%	7,6871%	NC	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 79.516.382,68	R\$ 80.501.397,03	0,0523	1,4123	1,2387	2,7222%	2,7222%	NC	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1.791,16	R\$ 4.112,97							
TOTAL	RS 133.020.477,76	RS 139.034.980,09							

Quadro 20.

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo do Amazonas - PGJMP2019

08/11/2019 15:41:59

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 31/10/2019		
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$	
				Saldo Financeiro em 31/10/2018
				98.393.038,26
11/2018	0,00	0,00	0,00	
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	
				Saldo Financeiro em 31/10/2019
				139.034.980,09
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	2,5350%	2,5969%	0,1000%	
Juros	6,0000%	4,9756%	0,4868%	
Meta	8,6871%	7,7017%	0,5872%	
Rentabilidade	10,4377%	9,3241%	1,7949%	
Resultado %	1,6107%	1,5064%	1,2006%	
Resultado R\$	1.818.734,00	1.720.211,88	1.606.436,45	

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 Outubro de 2019

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/09/2019	31/10/2019	ago/19	set/19	out/19	TRIMESTRE	2019	ULTIMOS 12 MESES
BRDESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 8.183.757,90	R\$ 9.113.108,56	0,0100	1,7580	1,6870	2,7417%	2,9667%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 0,00	R\$ 0,00						
TOTAL	R\$ 8.183.757,90	R\$ 9.113.108,56						

Quadro 22.

5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo do Amazonas - DEFENSORIA2019

08/11/2019 15:34:15

Fundo Previdenciário

Cálculo Posicionado em 31/10/2019

Mês/Ano	Saldo Financeiro em 31/10/2018		Resultado RS
	Receitas RS	Despesas RS	
11/2018	598.798,24	0,00	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
	Saldo Financeiro em 31/10/2019		9.113.108,56

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	2,5350 %	2,5969 %	0,1000 %
Juros	6,0000 %	4,9756 %	0,4868 %
Meta	8,6871 %	7,7017 %	0,5872 %
Rentabilidade	11,7567 %	9,7054 %	1,7714 %
Resultado %	2,8242 %	1,8604 %	1,1773 %
Resultado RS	119.726,58	94.074,76	96.911,12

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 Outubro de 2019

6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/09/2019	31/10/2019	ago/19	set/19	out/19	TRIMESTRE	2019	
BRANDESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 12.556.825,07	R\$ 15.027.138,35	0,0100	1,7580	1,6870	3,4850%	5,3359%	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 33.652,16	R\$ -						
TOTAL	R\$ 12.590.477,23	R\$ 15.027.138,35						

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

Ciente: Governo do Amazonas - TRIBUNALDEJUSTICA2019

08/11/2019 15:48:47

Fundo Previdenciário

Cálculo Posicionado em 31/10/2019

Mês/Ano	Saldo Financeiro em 31/10/2018		Resultado RS
	Receitas R\$	Despesas R\$	
11/2018	0,00	0,00	0,00
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
	Saldo Financeiro em 31/10/2019		15.027.138,35

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	2,5350%	2,5969%	0,1000%
Juros	6,0000%	4,9756%	0,4868%
Meta	8,6871%	7,7017%	0,5872%
Rentabilidade	4,1140%	3,4167%	-0,5357%
Resultado %	-4,2077%	-3,9786%	-1,1164%
Resultado R\$	-147.882,06	-167.773,08	-141.382,34

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 Outubro 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 (%)					
	30/09/2019	31/10/2019	ago19	set19	out19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO INST. FIC F I R F I M A B 5	R\$ 1.451.292,56	R\$ 1.931.682,23	(0,2259)	1,7580	1,6870	3,2409%	3,2409%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 451.926,58	R\$ 447.922,04						
TOTAL	R\$ 1.903.219,14	R\$ 2.379.604,27						

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

08/11/2019 15:43:47

Fundo Previdenciário

Cálculo Posicionado em 31/10/2019

Mês/Ano	Saldo Financeiro em 31/10/2018		Resultado RS
	Receitas RS	Despesas RS	
11/2018	0,00	0,00	0,00
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
	Saldo Financeiro em 31/10/2019		2.379.604,27

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	2,5350%	2,5969%	0,1000%
Juros	6,0000%	4,9756%	0,4868%
Meta	8,6871%	7,7017%	0,5872%
Rentabilidade	14,6844%	12,0952%	1,4955%
Resultado %	5,5179%	4,0793%	0,9030%
Resultado RS	21.039,53	18.807,94	17.286,59

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 Outubro de 2019

8. CONSOLIDADO – FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

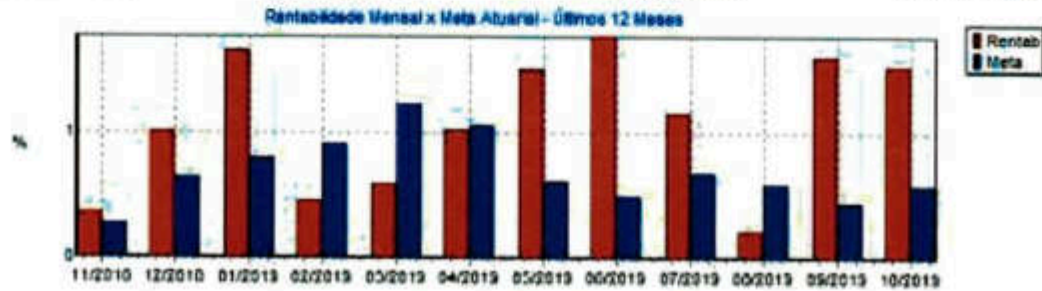
Cliente: Governo do Amazonas - CONSOLIDADO2019

08/11/2019 15:38:18

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 31/10/2019	
		Saldo Financeiro em 31/10/2018	4.000.107.062,34
Mês/Ano	Receitas RS	Despesas RS	Resultado RS
11/2018	34.480.401,28	1.464.475,87	33.015.925,41
12/2018	77.442.254,35	2.413.960,02	75.028.294,33
01/2019	25.980.772,80	1.624.312,33	24.356.460,47
02/2019	36.824.540,83	1.577.166,50	35.247.374,33
03/2019	50.641.754,07	1.653.421,67	48.988.332,40
04/2019	29.139.859,23	1.484.969,43	27.654.889,80
05/2019	38.446.158,11	1.872.658,21	36.573.499,90
06/2019	53.197.494,62	2.083.872,50	51.113.622,12
07/2019	47.110.321,11	2.328.050,08	44.782.271,03
08/2019	49.779.512,92	1.988.640,85	47.790.872,07
09/2019	51.923.350,05	2.305.655,41	49.617.694,64
10/2019	48.634.602,75	2.318.685,20	46.315.917,55
		Saldo Financeiro em 31/10/2019	5.105.203.939,44

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	2,5350 %	2,5969 %	0,1000 %
Juros	6,0000 %	4,9756 %	0,4868 %
Meta	8,6871 %	7,7017 %	0,5872 %
Rentabilidade	13,8296 %	12,2265 %	1,5461 %
Resultado %	4,7314 %	4,2012 %	0,9532 %
Resultado RS	217.217.921,47	195.700.791,79	47.768.459,02



Fonte: ACTUARIAL - Assessoria e Consultoria Atuarial Ltda - Anuário Responsável: Luiz Claudio Kogut MBA: 1.308

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).

20

Relatório de Investimentos Outubro de 2019

9. RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/09/2019	31/10/2019
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	2.783.032,18	602.109,51
BRADESCO FIC FI RF ALOC. DINÂMICA - COMPREV	R\$ 3.707.448,88	R\$ 3.862.015,29
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ -	R\$ -
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 9.720.176,78	R\$ 8.436.129,36
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 332.170,15	R\$ 61.982,37
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1.757.751,60	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 18.300.579,59	R\$ 12.962.237,53

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	
	30/09/2019	31/10/2019
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 355.594,24	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 140,76
TOTAL	R\$ 355.595,24	R\$ 140,76

Quadro 30.

9.3 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/09/2019	31/10/2019
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 230.625,52	R\$ 207.343,82
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 41.121,17	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 5.425,65	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 277.172,34	R\$ 207.344,82

Quadro 31.

9.4 Composição dos Recursos – ALE FFIN

DESCRIÇÃO	ago/19	set/19	out/19
SALDO ANTERIOR	R\$ 690.771,68	R\$ 201.137,82	R\$ 277.172,34
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	R\$ 993.186,16	R\$ 937.433,79	R\$ 935.792,49
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ 1.882.228,58	R\$ 1.433.159,86	R\$ 1.439.142,00
VARIAÇÃO FINANCEIRA	R\$ 1.783,56	R\$ 1.696,03	R\$ 2.030,81
(-) SAIDAS FINANCEIRAS	-R\$ 3.366.832,16	-R\$ 2.296.255,16	-R\$ 2.446.792,82
SALDO FINAL	R\$ 201.137,82	R\$ 277.172,34	R\$ 207.344,82

Quadro 32.

Relatório de Investimentos Outubro de 2019

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/09/2019	31/10/2019
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 557.019,53	R\$ 352.423,49
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ 193.062,64	R\$ 380.480,87
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 750.082,17	R\$ 732.904,36

Quadro 33.

10. TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/09/2019	31/10/2019	ago/19	set/19	out/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.725.442,60	R\$ 2.133.717,59	0,4791	0,4429	0,4560	1,3843%	4,9274%	4,9274%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 40.878.054,05	R\$ 41.577.213,00	(0,1295)	2,1183	1,7103	3,7303%	5,3087%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00						
TOTAL	R\$ 43.603.497,65	R\$ 43.710.931,59						

Quadro 34.

10.2 Taxa de Administração - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/09/2019	31/10/2019	ago/19	set/19	out/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 655.506,39	R\$ 690.889,04	0,4886	0,4508	0,2018	1,1454%	4,7207%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 32.283,83	R\$ 32.497,86						
TOTAL	R\$ 687.790,22	R\$ 690.889,04						

Quadro 35.

10.3 Taxa de Administração - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/09/2019	31/10/2019	ago/19	set/19	out/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 92.195,32	R\$ 138.089,66	-	-	0,2576	0,2576	0,2576	NC
TOTAL	R\$ 92.195,32	R\$ 138.089,66						

Quadro 36.

11. OUTROS RECURSOS

11.1 Tribunal de Justiça do Estado - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	30/09/2019	31/10/2019	ago/19	set/19	out/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO IRF MI - TJA	R\$ 32.944.323,00	R\$ 22.381.409,81	0,5248	0,6212	0,6016	1,7578%	5,7286%	6,8555%
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TJA	R\$ 183.618.825,79	R\$ 184.733.060,70	0,5250	0,6268	0,6068	1,7688%	11,8716%	6,9281%
BB PREV. RF IRF MI - TJA	R\$ 179.635.274,23	R\$ 180.710.774,36	0,5169	0,6193	0,5987	1,7450%	5,7463%	6,8664%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1.520.335,35	R\$ 5.354.229,30						
TOTAL	R\$ 397.718.758,37	R\$ 393.179.474,17						

Quadro 37.

Relatório de Investimentos Outubro de 2019

11.2 Composição dos Saldos - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	ago/19	set/19	out/19
SALDO ANTERIOR	403.938.484,46	399.140.654,65	397.718.758,37
CONTRIB. PREVIDENCIÁRIA	5.729.117,90	5.536.233,95	5.545.375,90
VARIAÇÃO FINANCEIRA	2.078.348,28	2.480.957,64	903.334,51
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(12.605.295,99)	(9.439.087,87)	(10.987.994,61)
SALDO FINAL	RS 399.140.654,65	RS 397.718.758,37	RS 393.179.474,17

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					
	30/09/2019	31/10/2019	ago/19	set/19	out/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO IRF MI - TCE	R\$ 12.153.928,59	R\$ 7.061.838,29	0,5248	0,6212	0,6016	1,7578%	5,7286%	6,8555%
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TCE	R\$ 72.200.786,04	R\$ 72.638.914,48	0,5250	0,6268	0,6068	1,7688%	11,8716%	6,9281%
BB PREV. RF IRF MI - TCE	R\$ 70.501.145,69	R\$ 70.923.245,37	0,5169	0,6193	0,5987	1,7450%	5,7463%	6,8664%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 812.770,21	R\$ 3.215.734,83						
TOTAL	RS 155.668.630,53	RS 153.839.732,97						

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	ago/19	set/19	out/19
SALDO ANTERIOR	160.380.303,38	156.783.790,54	155.668.630,53
CONTRIB. PREVIDENCIÁRIA	2.416.406,61	2.368.358,95	1.738.581,72
VARIAÇÃO FINANCEIRA	830.389,75	972.482,79	915.133,66
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(6.843.309,20)	(4.456.001,75)	(4.482.612,94)
SALDO FINAL	RS 156.783.790,54	RS 155.668.630,53	RS 153.839.732,97

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 Outubro 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 3.922/2010					
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR							
TÍTULOS DO TN	R\$ 626.290.867,88	11,12%	11%	100%	100%	art. 7º, inciso I, "a"					
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM I FIC FI	R\$ 251.634.019,73	55,85%	50%	100%	100%	art. 7º, inciso I, "b"					
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 19.565.023,97										
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ -										
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 283.714.686,69										
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDK A 2	R\$ 899.217.854,20										
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 180.680.849,67										
SANTANDER IMA B INST. TP RF LP	R\$ 24.029.226,34										
BRADESCO FI RF IRFM I TP	R\$ 29.443.248,10										
CAIXA FI BRASIL IRFM I TP RF	R\$ 257.371.975,18										
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 779.421.554,14										
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 90.740.854,56										
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 44.154.717,62										
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 52.467.611,49										
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 53.648.843,22										
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 113.049.579,80										
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 65.379.080,80	18,37%	40%	40%	40%	art. 7º, inciso IV, "a"					
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 6.172.858,80										
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ -										
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 269.395.263,47										
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 100.066.236,97										
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 49.169.983,24										
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 9.424.909,16										
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 266.888.850,87										
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 333.146.956,81										
ICATÚ VANG. FIFR INFLAÇÃO CP LP	R\$ 12.733.501,77						0,23%	1%	2%	5%	art. 7º, inciso VII, "b"
TÍTULOS CVS	R\$ 12.479.981,68						0,22%	ATIVO EM ENQUADRAMENTO	ATIVO EM ENQUADRAMENTO	-	TÍTULO NÃO REGISTADO NO SELIC
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 4.830.288.536,16						85,78%				

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2019		LIMITE DA RESOLUÇÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR		
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 21.251.851,05	0,38%	8%	15%	30%	art. 8º, inciso I, "a"
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 63.121.490,14	13,41%	8%	15%	20%	art. 8º, inciso II, "a"
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 4.819.504,01					
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 142.812.566,60					
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 135.427.389,51					
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 244.995.957,30					
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 62.570.039,57					
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 30.898.851,94					
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 70.668.017,83					
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 12.326.518,71					
SAFRA CONSUMO AMERICANO	R\$ 5.756.005,34					
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.768.219,69	0,42%	3%	10%	10%	art. 8º, inciso III
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 809.416.411,69	14,22%				
TOTAL GERAL DA CARTEIRA	R\$ 5.630.704.947,85	100,00%				

Quadro 41.

Relatório de Investimentos Outubro 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 1 FIC FI	R\$ 251.634.019,73	4,40%	20%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 19.565.023,97	0,34%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ -	0,00%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 283.714.686,69	4,96%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 899.217.854,20	15,72%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 9.424.909,16	0,16%	
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 180.680.849,67	3,16%	
BRADESCO FI RF IRFM 1 TP	R\$ 29.443.248,10	0,51%	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 257.371.975,18	4,50%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 779.421.554,14	13,63%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 90.740.854,56	1,59%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 44.154.717,62	0,77%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 52.467.611,49	0,92%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 6.172.858,80	0,11%	
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ -	0,00%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 269.395.263,47	4,71%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 100.066.236,97	1,75%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 49.169.983,24	0,86%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 21.251.851,05	0,37%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 266.888.850,87	4,67%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 333.146.956,81	5,82%	
SANTANDER IMA B INST. TP RF LP	R\$ 24.029.226,34	0,42%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 63.121.490,14	1,10%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 135.427.389,51	2,37%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 4.819.504,01	0,08%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 142.812.566,60	2,50%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 244.995.957,30	4,28%	
ICATÚ VANG. FI RF INFAÇÃO CP LP	R\$ 12.733.501,77	0,22%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 53.648.843,22	0,94%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 113.049.579,80	1,98%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 62.570.039,57	1,09%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 70.668.017,83	1,24%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 30.898.851,94	0,54%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 12.326.518,71	0,22%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO	R\$ 5.756.005,34	0,10%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 65.379.080,80	1,14%	
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.768.219,69	0,10%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO	R\$ 5.001.359.007,45		
TÍTULOS DO TN	R\$ 626.290.567,88		
IMÓVEIS	R\$ 62.060.000,00		
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 17.933.234,36		
FCVS	R\$ 12.479.981,68		
TOTAL DO RECURSOS	R\$ 5.720.123.091,37		
TOTAL DAS APLICAÇÕES DOS RECURSOS	R\$ 5.630.704.947,85		

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.

Relatório de Investimentos Outubro 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 I FIC FI	R\$ 251.634.019,73	7.511.019.292,51	3,35%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	R\$ 19.565.023,97	681.504.634,21	2,87%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX - 15/08/2018	R\$ -	83.944.618,77	0,00%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 283.714.686,69	3.222.349.506,29	8,80%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 899.217.854,20	7.906.000.337,57	11,37%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 9.424.909,16	8.931.824.899,36	0,11%	
BRADESCO FI RF IRFM I TP	R\$ 29.443.248,10	733.085.810,57	4,02%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 6.172.858,80	324.091.849,45	1,90%	
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ -	8.683.428.533,13	0,00%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 269.395.263,47	5.637.344.316,36	4,78%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 100.066.236,97	831.069.848,83	12,04%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 49.169.983,24	897.957.354,97	5,48%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 21.251.851,05	213.689.786,59	9,95%	
CAIXA FI BRASIL IRF M I TP RF	R\$ 257.371.975,18	11.285.978.738,46	2,28%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 779.421.554,14	10.184.716.977,20	7,65%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 90.740.854,56	3.319.372.416,38	2,73%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 44.154.717,62	258.525.650,13	17,08%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 52.467.611,49	214.119.226,36	24,50%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 333.146.956,81	8.654.594.983,92	3,85%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 4.819.504,01	375.478.889,24	1,28%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 266.888.850,87	5.147.659.268,69	5,18%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 63.121.490,14	861.773.682,12	7,32%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 142.812.566,60	2.102.836.709,28	6,79%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 135.427.389,51	3.774.193.693,93	3,59%	
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 180.680.849,67	1.319.606.230,39	13,69%	
SANTANDER IMA B INST. TP RF LP	R\$ 24.029.226,34	1.516.704.216,68	1,58%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 70.668.017,83	739.502.738,27	9,56%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 30.898.851,94	723.179.881,48	4,27%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 244.995.957,30	1.993.814.995,42	12,29%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 53.648.843,22	567.112.773,62	9,46%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 113.049.579,80	1.357.858.917,79	8,33%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 65.379.080,80	1.942.239.655,23	3,37%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 62.570.039,57	1.541.004.268,10	4,06%	
TOTAL	R\$ 4.964.774.761,94			

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\$ 5.768.219,69	287.081.958,08	2,01%	5%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 12.326.518,71	357.809.598,83	3,44%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO	R\$ 5.756.005,34	494.974.177,96	1,16%	
ICATÚ VANG. FI RF INFAÇÃO CP LP	R\$ 12.733.501,77	535.535.789,95	2,38%	
TOTAL	R\$ 36.584.245,51			

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 I);


 26

Relatório de Investimentos Outubro 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 SET/19) EM R\$ MI	TOTAL RECURSOS AMAZONPREV (OUTUBRO/2019)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB DTVM S.A	R\$ 1.055.968,99	R\$ 1.454.131.584,59	0,1377%	5%
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 745.216,72	R\$ 608.250.297,12	0,0816%	
BRADESCO	R\$ 580.424,22	R\$ 475.499.441,63	0,0819%	
CAIXA	R\$ 373.081,00	R\$ 1.567.891.393,50	0,4203%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	R\$ 278.762,94	R\$ 306.276.945,78	0,1099%	
BANCO BTG	R\$ 107.426,05	R\$ 62.570.039,57	0,0582%	
BANCO SAFRA	R\$ 95.985,77	R\$ 83.461.604,85	0,0870%	
ICATÚ VANGUARDA DTVM S/A	R\$ 23.627,74	R\$ 424.427.882,09	1,7963%	

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.

Relatório de Investimentos Outubro de 2019

13. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

FPREV PODER EXECUTIVO	SALDO
FUNDO DE INVESTIMENTO FPREV - EXECUTIVO	R\$ 4.228.907.911,73
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 624.183.567,52
TÍTULOS PÚBLICOS - CVS	R\$ 12.479.981,68
IMÓVEIS	R\$ 62.060.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EXECUTIVO	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 4.927.631.461,93

ASSEMBLEIA LEGISLATIVA	SALDO
ALE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 9.910.345,89
ALE FPREV TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.107.300,36
ALE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
ALE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 207.343,82
ALE FFIN DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - ALE COBERTURA	R\$ -
TOTAL	R\$ 12.224.991,07

PROCURADORIA GERAL DE JUSTIÇA - PGJ/MPE	SALDO
MPE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 139.030.867,12
MPE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 4.112,97
MPE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 352.423,49
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - PGJ/MPE - FFIN	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - MPE COBERTURA	R\$ 380.480,87
TOTAL	R\$ 139.767.884,45

DEFENSORIA PÚBLICA - DPE/AM	SALDO
DPE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 9.113.108,56
DPE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
DPE - FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - DPE - FFIN	R\$ 140,76
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - DPE COBERTURA	R\$ -
TOTAL	R\$ 9.113.249,32

TRIBUNAL DE JUSTIÇA - TJ/AM	SALDO
TJ/AM FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 387.825.244,87
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA	R\$ 5.354.229,30
TJ/AM - FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 15.027.138,35
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA - FPREV	R\$ -
TOTAL	R\$ 408.206.612,52

TRIBUNAL DE CONTAS DO ESTADO - TCE/AM	SALDO
TCE/AM FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 150.623.998,14
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TCE	R\$ 3.215.734,83
TCE/AM - FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 1.931.682,23
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TCE/FPREV	R\$ 447.922,04
TOTAL	R\$ 156.219.337,24

OUTROS RECURSOS	SALDO
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO EXECUTIVO	R\$ 43.710.930,59
DISP. FINANCEIRA - TAXA DE ADM. EXECUTIVO	R\$ 1,00
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - ALE	R\$ 690.889,04
DISP. FINANCEIRA - TX DE ADM. ALE	R\$ 32.497,86
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO TCE	R\$ 138.089,66
DISP. FINAN CEIRA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO TCE	R\$ -
FUNDO FINANCEIRO - EXECUTIVO	R\$ 602.109,51
FUNDO FINANCEIRO - COMPREV	R\$ 3.862.015,29
DISP. FINANCEIRA - FFIN EXECUTIVO	R\$ 1,00
DISP. FINANCEIRA - FFIN EXECUTIVO - COBERT. DEFICIT	R\$ 8.436.129,36
DISP. FINANCEIRA - SAL. NÃO RECLAMADOS	R\$ 61.982,37
DISP. REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ -
TOTAL	R\$ 57.534.645,68
TOTAL GERAL	R\$ 5.710.698.182,20

Quadro 45.



Gráfico 4.

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

29

Relatório de Investimentos Outubro de 2019

15. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV EXECUTIVO:	a) Novos Recursos: deverão ser rateados entre os fundos ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FI (06.224.719/0001-92) e Bradesco FIC FIA IBx Alpha. Conforme registrado, os fundos Icatu Vanguarda Dividendos e Itaú Duxamis fecharam para captação, além disso, a estratégia para fundos do art. 8º, II-a está próxima do limite estabelecido pela Política de Investimentos, de forma que se faz necessário direcionar recursos para fundos do art. 8º, I-a que possuem margem para aplicação. O COMIV informa que a estratégia principal era alocar recursos até o limite do artigo 8,II-a, conforme política de investimentos, reavaliando mensalmente a estratégia.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2019
	b) Fundos de Curto Prazo: Manter, regularmente, saldo de aplicação no fundo Bradesco Maxi Poder Público no valor de R\$ 2.000.000,00 (dois milhões de reais), já que possui baixa automática otimizando o processo de pagamentos de rotina, incluindo folha de pagamento de aposentados e pensionistas do FPREV.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2019
	c) Demais recursos: Migrar R\$ 50 milhões do fundo BB Previdenciário IDKA 2 para o fundo BB Ações Valor FIC FIA (28.258.294/0001-38).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2019
	d) Migrar R\$ 50 milhões do fundo Bradesco DI Premium para o fundo Bradesco Alocação Dinâmica.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2019
	e) Migrar R\$ 50 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	15/12/2019
	f) Migrar R\$ 20 milhões do ITAU Institucional Alocação Dinâmica RF FIC para o fundo AZ Quest Small Mid Caps FIC FIA (11.392.165/0001-72).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2019
FPREV ALE:	Novos Recursos: Ratear 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	15/12/2019
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	15/12/2019
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	15/12/2019
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 Amazonprev.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2019
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 Amazonprev.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2019
Outros Repasses – TCE e TJAM:	a) Novos recursos: os novos recursos recebidos pelo TCE e TJAM, devem ser direcionados para os fundos Caixa Gestão Estratégica e BB Previdenciário RF Alocação Ativa.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2019
	b) Resgatar os recursos aplicados nos Fundos BB PREV IRFM 1 TP RF e CAIXA FI BRASIL IRF M 1 e aplicá-los nos Fundos Caixa Gestão Estratégica e BB Previdenciário RF Alocação Ativa.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2019
	c) Resgatar os recursos do Fundo BRADESCO IRF M1 TP, tanto do TJA e TCE, e aplicá-los no Fundo Maxi Poder Público, tal estratégia visa otimizar o processo de pagamentos da folha de aposentados e pensionistas dos tribunais.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2019
FFIN - EXECUTIVO, ALE, DPE e MPE:	Aplicar os recursos no fundo Bradesco Maxi Poder Público, facilitando a operacionalização dos pagamentos das folhas de inativos e pensionistas desses órgãos. Devem ser observados os limites para aplicação conforme legislação vigente.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2019
RECURSOS COMPREV:	Manter os recursos aplicados no fundo Bradesco Alocação Dinâmica, de forma manter o enquadramento dos recursos da Amazonprev.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2019
DISPONIBILIDADES DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	Os Novos Recursos repassados pelo Poder Executivo, devem ser aplicados no fundo Maxi poder Público, direcionando o residual, se houver, para o Fundo Caixa Gestão Estratégica. Aos valores repassados pelos demais órgãos serão mantidas as aplicações atuais.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2019
FATOS RELEVANTES 1.	POLÍTICA DE INVESTIMENTO 2020. Os membros do Comitê concluíram análise final sobre as Propostas para a Política de Investimentos 2020, onde ficou definido que, após Certificação Nível II do Prô Gestão, a Estratégia de Alocação de Recursos terá o limite máximo permitido de 40% (quarenta por cento) em Renda Variável.	COMIV	Após aprovação pelos Conselhos
FATOS RELEVANTES 2.	APLICAÇÕES BANCO BTG. Os membros do Comitê decidiram em manter os recursos aplicados no Banco. A decisão foi tomada após análise de dados do fundo BTG ABSOLUTO FIQ FIA, sendo observado que o fundo não apresentou nenhuma redução na quantidade de cotistas, no patrimônio líquido e seu retorno ficou dentro dos parâmetros do mercado. Outra informação importante, é que o Fundo não possui ativos do Banco BTG na sua carteira.	COMIV	Após aprovação pela Diretoria

Quadro 46.

Relatório de Investimentos Outubro 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	1,66%	1,48%	2,78%	2,48%	3,38490	-0,23%	-0,49%
BB PREVID IMA B 5+ TIT PUB RF	5,70%	6,93%	9,56%	11,52%	4,39166	-0,51%	-4,20%
BB PREVID RF IRFM 1 TP	0,30%	0,25%	0,52%	0,44%	2,89408	-0,03%	-0,03%
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC DE FI	1,88%	2,26%	3,16%	3,77%	4,02958	-0,16%	-1,22%
BB PREVID TIT PUB VII FI	1,18%	1,32%	1,98%	2,22%	3,23841	-0,15%	-0,52%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	1,98%	2,14%	3,34%	3,57%	4,06829	-0,15%	-1,09%
BRANCO FEDERAL EXTRA	0,00%	0,02%	0,02%	0,06%	-6,03214	0,00%	0,00%
BRANCO FI REFER DI PREMIUM	0,01%	0,02%	0,04%	0,00%	-1,20407	0,00%	0,00%
BRANCO FIC FIA INSTITUCIONAL	15,90%	18,08%	26,26%	29,85%	1,13411	-4,39%	-8,04%
BRANCO INST. FIC FI RF IMA B5	2,06%	2,04%	3,45%	3,40%	3,70294	-0,20%	-0,81%
BRANCO IRFM 1 TP	0,24%	0,29%	0,49%	0,50%	3,51770	-0,03%	-0,03%
BRANCO MAXI PD PÚBLICO	0,00%	0,02%	0,02%	0,06%	-10,92473	0,00%	0,00%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	15,24%	17,37%	25,17%	28,70%	1,82676	-3,33%	-7,45%
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	0,75%	3,88%	1,26%	6,39%	-0,98973	-1,88%	-2,72%
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	3,05%	5,04%	5,12%	8,34%	1,42887	-1,19%	-3,54%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF	1,97%	1,95%	3,31%	3,25%	3,81658	-0,19%	-0,71%
CAIXA FI BRASIL IMA B5+	5,67%	6,81%	9,51%	11,33%	4,43725	-0,49%	-4,17%
CAIXA FI BRASIL IRFM 1	0,30%	0,24%	0,52%	0,42%	3,26376	-0,03%	-0,03%
CAIXA FIA CONSUMO	15,89%	17,86%	26,07%	29,52%	2,06664	-3,76%	-10,18%
CAIXA GESTÃO ESTRATEGICA	2,27%	3,73%	3,80%	6,20%	3,26466	-0,18%	-2,73%
FIC CAIXA CAPITAL PROTEGIDO	2,53%	1,02%	4,29%	1,72%	2,50967	-0,07%	-0,10%
ICATU DIVIDENDOS FIA	14,15%	15,21%	23,37%	25,16%	2,37245	-4,87%	-6,99%
ICATU INFLAÇÃO CRÉDITO PRIVADO	1,96%	1,85%	3,29%	3,09%	4,01740	-0,19%	-0,77%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA	2,02%	1,99%	3,39%	3,32%	3,79171	-0,20%	-0,74%
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA	5,74%	6,88%	9,63%	11,44%	4,42539	-0,50%	-4,22%
ITAU AÇÕES PHOENIX FIC FI	13,27%	17,99%	21,89%	29,71%	1,40429	-7,46%	-9,05%
ITAU DUNAMIS FIC	14,15%	17,28%	23,40%	28,56%	1,71302	-3,26%	-9,59%
ITAU FOF RPI AÇÕES	15,42%	16,95%	25,48%	27,98%	1,22798	-4,37%	-9,09%
ITAU INSTIT ALOC DINÂMICA RF FIC	0,10%	2,19%	0,19%	3,65%	3,43510	0,00%	-1,15%
SAFRA CONSUMO AMERICANO	14,67%	14,64%	24,13%	24,18%	1,44871	-3,65%	-17,03%
SAFRA IMA INST. FI FIC RF	0,00%	5,34%	0,06%	8,88%	4,60191	0,00%	-3,33%
SAFRA S&P REAIS PB MM	12,92%	14,71%	21,37%	24,26%	0,65509	-4,13%	-16,71%
SANTANDER AÇÕES TOP SELEÇÃO	16,28%	17,72%	26,87%	29,25%	1,05107	-4,44%	-7,65%
SANTANDER FIC FI IMA B	3,90%	4,64%	6,55%	7,72%	4,37388	-0,31%	-2,73%
SANTANDER FIC IMA-B 5 TIT PUB RF	1,97%	1,95%	3,31%	3,25%	3,78813	-0,19%	-0,71%
SANTANDER IBOVESPA AÇÕES	16,59%	18,14%	27,38%	29,93%	0,93972	-5,14%	-8,80%

RISCOS DA CARTEIRA AMAZONPREV

out/19							
CARTEIRA AMAZONPREV	2,77%	2,36%	4,63%	3,93%	3,13020	-0,47%	-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



Relatório de Investimentos Outubro 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.



Handwritten signatures and initials in blue ink, including a large 'Q' and several smaller signatures.

Relatório de Investimentos Outubro de 2019

16.2 DETALHAMENTO POR FUNDO DE INVESTIMENTOS

FUNDO DE INVESTIMENTOS	CNPJ	GESTOR	ENQUADRAMENTO	ESPECIMENS	SALDO	PREZO DE PRECISAÇÃO DO ATIVO	PRAZO DE BILIGATE	LIQUIDEZ	VOLATILIDADE ATRIBUÍDA PELO ADMINISTRADOR	CONCEITO DA VOLATILIDADE REFERENCIAL (RBC-01)	TAXA DE ADOÇÃO DE INVESTIMENTO
BB PREV FIC IMA 3	11.322.706/0001-35	BB DTVM	ART. 7.º, I, "b"	IMA IPCA 2A	899.237.854,20	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	1,000%
BB PREVID FIC IMA 1 TP	11.328.882/0001-35	BB DTVM	ART. 7.º, I, "b"	IPF-MI	251.634.019,73	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	2,500%
BRADSCOFI FIC REFER DI PREMIUM	03.399.431/0001-90	BRAM - DTVM	ART. 7.º, IV, "a"	CDI	269.395.263,47	INDETERMINADO	D+0	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,200%
BRADSCOFI FIC MAMI PODER PUB	08.746.261/0001-97	BRAM - DTVM	ART. 7.º, IV, "a"	CDI	6.172.854,80	INDETERMINADO	D+0	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,200%
BRADSCOFI FIC RENDA FIC IMA-B	11.484.558/0001-06	BRAM - DTVM	ART. 7.º, I, "b"	IPF-MI	29.443.748,10	INDETERMINADO	D+0	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,200%
NTN-B	-	TESOURO NACIONAL	ART. 7.º, I, "b"	IPCA + 6,48% a.a.	359.538.674,73	15/06/2023	D+1	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
NTN-B	-	TESOURO NACIONAL	ART. 7.º, I, "b"	IPCA + 6,59% a.a.	354.318.771,06	15/08/2020	D+1	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
NTN-B	-	TESOURO NACIONAL	ART. 7.º, I, "b"	IPCA + 6,90% a.a.	357.467.194,09	15/08/2020	D+1	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
NTN-B	-	TESOURO NACIONAL	ART. 7.º, I, "b"	IPCA + 6,60% a.a.	359.870.937,17	15/08/2040	D+1	CURTO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
CVS - A	-	TESOURO NACIONAL	Em enquadramento	0,50% a.m.	1.501.799,26	01/01/2027	-	LONGO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
CVS - B	-	TESOURO NACIONAL	Em enquadramento	3,12% a.a.	9.171.693,76	01/01/2027	-	LONGO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
CVS - C	-	TESOURO NACIONAL	Em enquadramento	0,50% a.m.	194.816,44	01/01/2027	-	LONGO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
CVS - D	-	TESOURO NACIONAL	Em enquadramento	3,12% a.a.	1.065.614,28	01/01/2027	-	LONGO PRAZO	1	MUITO BAIXO	0,000%
BB PREVID TIT PUB VII F1	19.523.306/0001-06	BB DTVM	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B	19.505.021,97	INDETERMINADO	D+1	MÉDIO PRAZO	2	BAIXO	0,200%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA	10.922.431/0001-01	ICATU VANGUARDIA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B-5	53.648.843,27	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	2	BAIXO	0,400%
CAIXA FI BRASIL IMA-B 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.740.670/0001-06	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	ART. 7.º, I, "b"	IPF-MI	257.371.975,18	INDETERMINADO	D+0	CURTO PRAZO	2	BAIXO	0,200%
BRADSCOFI FIC FI RE ALOCAÇÃO DINÂMICA	28.515.874/0001-09	BRAM - DTVM	ART. 7.º, IV, "a"	IPCA	49.169.985,24	INDETERMINADO	D+4	CURTO PRAZO	2	BAIXO	0,400%
SAFRA S&P REALIS PR MM	21.576.876/0001-54	SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA	ART. 8.º, III	CDI	12.316.518,71	INDETERMINADO	D+2	CURTO PRAZO	2	BAIXO	0,200%
BRADSCOFI FIC IMA-B 5	20.216.216/0001-04	BRAM - DTVM	ART. 7.º, IV, "a"	IMA-B-5	100.066.236,97	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	3	MÉDIO	0,200%
CAIXA BI GESTÃO ESTRATÉGICA	21.215.097/0001-55	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7.º, IV, "a"	IPCA	313.146.956,81	INDETERMINADO	D+0	CURTO PRAZO	3	MÉDIO	1,400%
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	21.791.028/0001-27	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7.º, I, "a"	IMA-B	44.154.717,62	16/08/2020	-	MÉDIO PRAZO	3	MÉDIO	1,600%
CAIXA FI BRASIL 2024 V TP RF	22.791.074/0001-26	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7.º, I, "a"	IMA-B	52.467.611,49	16/08/2024	-	LONGO PRAZO	3	MÉDIO	2,000%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL RF LP	14.504.578/0001-90	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B-5	24.029.225,34	INDETERMINADO	D+4	CURTO PRAZO	3	MÉDIO	0,200%
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF	11.060.913/0001-10	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B-5	279.421.554,14	INDETERMINADO	D+0	CURTO PRAZO	3	MÉDIO	0,400%
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5A	10.577.508/0001-88	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B-5A	90.760.864,56	INDETERMINADO	D+0	CURTO PRAZO	3	MÉDIO	0,700%
SANTANDER FIC IMA-B 5 TP RF	13.495.117/0001-01	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B-5	180.680.849,67	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	3	MÉDIO	0,250%
BTG ABSOLUTO FIC FIA	11.977.794/0001-64	BTG Paulista Asset Management S.A. DTVM	ART. 8.º, II, "a"	IBOVESPA	62.570.029,57	INDETERMINADO	D+33	CURTO PRAZO	4	ALTO	3,000%
CAIXA FIA CONSUMO	10.577.512/0001-79	CAIXA ECONÔMICA	ART. 8.º, II, "a"	ICON	4.819.504,01	INDETERMINADO	D+3	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,10% a.o. 30%
FIC CAIXA CAPITAL PROTEGIDO	14.386.860/0001-10	CAIXA ECONÔMICA	ART. 8.º, III	IBOVESPA	5.768.219,69	01/10/2020	-	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,700%
ICATU INVÍDIOS FIA	08.279.104/0001-43	ICATU VANGUARDIA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8.º, II, "a"	IBOVESPA	244.995.957,30	INDETERMINADO	D+4	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,200%
ICATU INFLAÇÃO CRÉDITO PRIVADO	19.719.727/0001-51	ICATU VANGUARDIA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, VII, "a"	IMA-B-5	13.733.503,77	INDETERMINADO	D+21	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,200%
SAFRA CONSUMO AMERICANO FI EM AÇÕES BDR-NÍVEL I	19.436.816/0001-80	BANCO J. SAFRA S/A	ART. 8.º, II	BDR-1	5.796.006,14	INDETERMINADO	D+2	CURTO PRAZO	4	ALTO	1,500%
BRADSCOFI FIC AÇÕES INSTITUCIONAIS BDR ALPHA	14.099.376/0001-78	BRAM - DTVM	ART. 8.º, I, "a"	IBOVESPA	21.251.861,06	INDETERMINADO	D+2	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,900%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIC A	30.659.164/0001-74	BANCO J. SAFRA S/A	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B	65.174.080,80	INDETERMINADO	D+4	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,200%
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA	10.766.041/0001-06	ICATU VANGUARDIA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B-5A	313.049.579,83	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,200%
ITAU INST. ALOC. DINÂMICA I	21.838.150/0001-49	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 7.º, IV, "a"	IPCA	266.888.801,87	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	4	ALTO	0,100%
BB PREVID TIT PUB IMA-B 5	13.327.340/0001-73	BB DTVM	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B-5A	283.754.686,69	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	2,500%
BB PREVIDCONFIOR FIC ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	25.078.994/0001-90	BB DTVM	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B	9.424.909,16	INDETERMINADO	D+3	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	0,100%
SANTANDER IBOVESPA INSTITUCIONAIS AÇÕES	01.699.688/0001-03	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8.º, II, "a"	IBOVESPA	30.896.851,64	INDETERMINADO	D+3	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	0,700%
ITAU AÇÕES PHENIX FIC FI	23.731.629/0001-07	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 8.º, II, "a"	IBOVESPA	142.812.566,60	INDETERMINADO	D+24	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	1,000%
ITAU DYNAMIS FIC FIA	24.571.469/0001-75	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 8.º, II, "a"	IBOVESPA	135.427.389,51	INDETERMINADO	D+24	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	1,000%
ITAU FOF IPI AÇÕES	08.817.414/0001-10	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 8.º, II, "a"	IBOVESPA	63.121.490,14	INDETERMINADO	D+5	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	0,600%
SANTANDER AÇÕES TOP SELECÇÃO	03.436.763/0001-05	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8.º, II, "a"	IBOVESPA	736.007.911,87	INDETERMINADO	D+4	CURTO PRAZO	5	MUITO ALTO	0,000%

Quadro 48.

Relatório de Investimentos Outubro de 2019

VOLATILIDADE DA CARTEIRA COM BASE NA NOTA DE RISCO DO ADMINISTRADOR

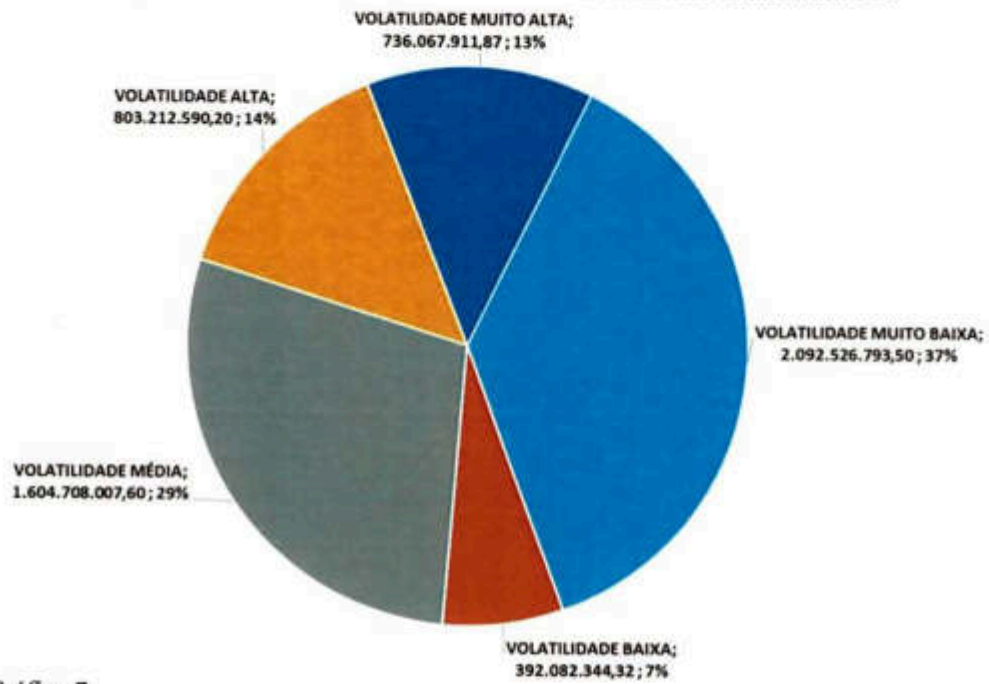


Gráfico 7.

[Handwritten signatures and initials]

34

Relatório de Investimentos Outubro de 2019

17. VERIFICAÇÃO DE LASTRO DOS FUNDOS DE RISCO DE CRÉDITO

CREDITO INFLAÇÃO			
TABELA - DURATION & YIELD POR CLASSE			
Ativo	Duração	Yield	% PL
DEB	3,33	0,96%	34,4%
CRF	0,00	0,00%	0,0%
LF	2,56	0,42%	12,3%
COB	1,11	0,33%	3,6%
DPSE	0,00	0,00%	0,0%
NP	0,00	0,00%	0,0%
FIDC	0,00	0,00%	0,0%
NTN-8	3,39	-	22,8%
Over	0,00	-	4,9%
Certific. Crédito	3,09	0,86%	72,3%
Crédito - Contribuição Fundo	0,65	0,62%	72,3%
Fundo (inclui DAP e NTN-8)	2,80	0,62%	100,0%

TABELA - RATING EXTERNO*		
Rating	Financiaria	% PL
AAA	122.259.639	22,6%
AA+	76.826.593	14,2%
AA	84.749.707	15,6%
AA-	12.617.717	2,3%
A+	25.779.969	4,8%
DPSE	0	0,0%
A	7.379.443	1,4%
A-	0	0,0%
BBB+	14.899.436	2,8%
BBB	0	0,0%
BBB-	0	0,0%
BB+	13.679.127	2,5%
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	32.254.317	6,0%
Tesouro / Over	149.890.300	27,7%
Total	541.676.343	100,0%

TABELA - SETOR		
Setor	Financiaria	% PL
Energico	122.208.359	22,6%
Bancos	86.731.194	16,0%
Saneamento	46.193.796	8,5%
Servico	22.437.433	4,1%
Cons. Paguevitas	17.877.341	3,3%
Óleo e Gas	16.148.032	3,0%
Shopping Center	16.037.126	3,0%
Holding	13.649.913	2,5%
Mineração e Siderurgia	13.156.388	2,4%
Consumo	11.631.526	2,1%
Varejo	10.379.974	2,0%
Infraestrutura	4.667.382	0,9%
Papel e Celulose	3.228.233	0,6%
Logística	3.003.224	0,6%
Tesouro / Over	149.890.300	27,7%
Total	541.676.343	100,0%

TABELA - EMISSOR		
Emissor	Financiaria	% PL
Empresas	18.714.964	3,5%
CPFL GERACÃO	18.708.492	3,5%
SANEPAR	15.830.269	2,9%
RIO PARANAPANEMA ENERGIA	13.381.430	2,5%
CEMIG D	13.659.155	2,5%
COFASA	12.745.641	2,4%
Libel	12.370.496	2,3%
Uliminas	11.799.331	2,2%
NATURA	11.631.328	2,1%
TABISA	10.972.374	2,0%
Banco FIDIS	10.713.405	2,0%
LOJAS AMERICANAS	10.379.974	2,0%
LOCALIZA	10.200.241	1,9%
SABESP	9.628.791	1,8%
Mercedes Benz	9.518.074	1,8%
Bredasco	9.080.329	1,7%
CCR AUTOBAN	9.037.180	1,7%
ABR TETE	8.873.614	1,6%
PETROBRAS	8.477.630	1,6%
Smartfit	8.336.674	1,5%
Drycovei	8.291.159	1,5%
Águas de Guarapós	7.989.096	1,5%
CDMS&S	7.690.382	1,4%
MULTIPLAN	7.481.287	1,4%
Banco RD	7.057.481	1,3%
Sofisa	6.820.276	1,3%
Alta	5.769.384	1,1%
Satris	5.421.772	1,0%
Direpolis	5.286.682	1,0%
Eneas	5.192.389	1,0%
Gerdev	4.667.382	0,9%
CCF	4.518.473	0,8%
COPEL	4.410.243	0,8%
TERMOPERNAMBUCO	4.148.642	0,8%
ECOVIAS	4.016.783	0,7%
EQUATORIAL	3.860.147	0,7%
BNS	3.693.233	0,7%
Dnvs	3.593.217	0,7%
VALE	3.361.237	0,6%
VORSEBEN	3.322.927	0,6%
Suzano	3.228.233	0,6%
Crise	3.216.373	0,6%
Itaú	3.099.422	0,6%
Entropopulo	3.028.221	0,6%
MRS LOGISTICA	3.003.224	0,6%
ABC Brasil	2.906.734	0,5%
ECORODOVIAS	2.769.591	0,5%
ENEL Rj	2.708.218	0,5%
Santa Antônio Energia	2.501.018	0,5%
Itau	2.483.783	0,4%
ENEL CEARÁ	2.406.463	0,4%
ECOPISTAS	2.159.813	0,4%
Banifuz	2.094.763	0,4%
EDP SAO PAULO	1.833.699	0,3%
Celis	1.810.307	0,3%
BRMALLS	1.740.294	0,3%
Indústria	1.603.943	0,3%
EDP ESPIRITO SANTO	1.433.433	0,3%
CPFL RGE	1.411.524	0,3%
SONAE SIERRA	1.387.802	0,3%
CPFL Piratininga	1.312.181	0,2%
GUATEMI	996.927	0,2%
COELBA	809.874	0,1%
Votorantim	678.941	0,1%
ENGE - MIRANDA	42.000	0,0%
Tesouro / Over	149.890.300	27,7%
Total	541.676.343	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 12 de novembro de 2019, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de Outubro/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 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 (pág. 30) e registradas em Ata de Reunião Ordinária do Comitê.

Manaus – AM, 12 de novembro de 2019.


Alan Nascimento
Coordenador


Bruno Costa Novo
Secretário


Bruno Barroso
Membro


Leonardo Cavalcanti
Membro


Marcos Souza
Membro


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: