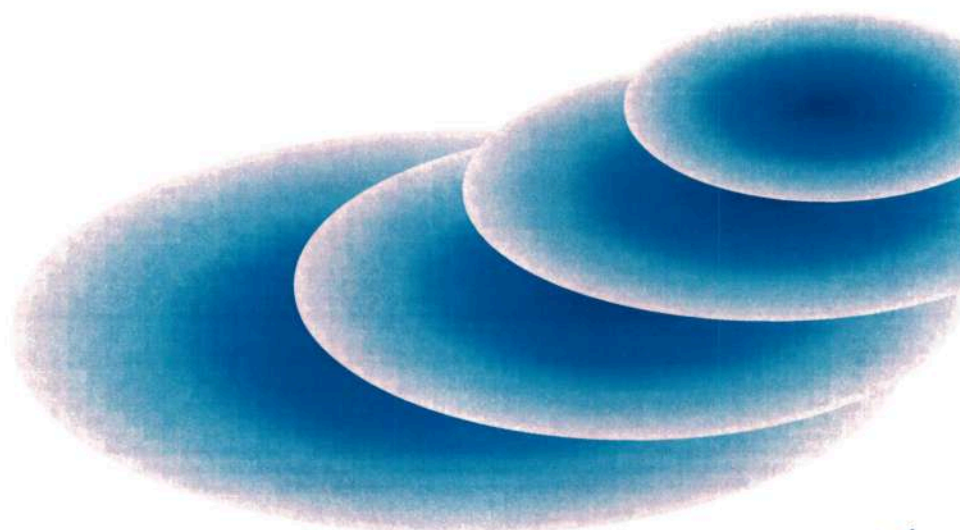




RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Setembro / 2019

RELATÓRIOS - 2019



Relatório de Investimentos setembro de 2019

Destino: DIRAF / PRESI

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

Data: 04/11/19

RELATÓRIO Nº 52/2019 – COMIV

Senhores Diretores,

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

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 03 a 04)
- 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 05 a 12)
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 12 e 14)
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (página 14)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (página 15)
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (página 15)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (página 15)
- 8) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado – FPREV (página 16)
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro: Executivo, DPE, ALE e MPE – (página 17)
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 18)
- 11) Outros Recursos Tribunal de Contas do Estado - TCE: Saldo e Composição (páginas 18)
- 12) Outros Recursos do Tribunal de Justiça – TJ/AM: Saldo e Composição (páginas 19)
- 13) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 20 a 23)
- 14) Total consolidado e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 24 e 25)
- 15) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 26)
- 16) Relatório de Risco dos Ativos (páginas 27 a 30).
- 17) Verificação de Lastro dos Fundos de Risco de Crédito (página 31)
- 18) Parecer do Comitê de Investimentos (página 32).
- 19) Aprovação do Conselho Fiscal (página 33).



Relatório de Investimentos setembro de 2019

1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

Em setembro, o Banco Central reduziu novamente a Selic para seu menor patamar histórico, 5,5%, ainda acenou com a possibilidade de mais um corte. Os principais fatores citados pelo BC foram a queda da inflação e a boa ancoragem das expectativas futuras. Em seu relatório trimestral sobre a inflação (RTI), divulgado na semana passada, o BC elaborou um pouco mais sobre os diferentes cenários, incluindo as expectativas dos agentes de mercado e suas próprias projeções. Mesmo considerando uma taxa de câmbio acima de R\$ 4 e a Selic chegando até 5%, a expectativa de inflação para 2020 continua situada abaixo da meta, em 3,8%. Com base no comunicado pelo BC, consideramos que ainda há a possibilidade de mais uma nova redução dos juros de 0,5% este ano. Na avaliação do balanço de riscos, o cenário externo e o potencial impacto no dólar podem restringir futuras quedas, bem como o andamento das reformas e a manutenção do teto de gastos fiscais.

A inflação em queda e as seguidas revisões das expectativas continuam sendo a surpresa do cenário econômico este ano. Os índices de preços em setembro continuam apontando para um cenário bastante benigno para a inflação. O IPCA-15 ficou em 0,09% e o IGP-M do mês fechou em -0,01%. Conforme comentamos nos meses anteriores, a inflação vem surpreendendo para baixo e resultando em contínuas revisões de expectativas tanto para 2019 como para 2020.

Além dos preços dos alimentos e combustíveis, os núcleos de inflação também estão baixos. No mês de setembro, a baixa inflação teve mais uma vez a contribuição da queda dos preços dos alimentos e combustíveis, que segue a tendência de preços das commodities no mercado internacional. Mas ressalta que as medidas de núcleo, que são os itens menos voláteis, como serviços por exemplo, também seguem estáveis, em torno de 3% ao ano. A lenta recuperação da atividade econômica, que ainda possui uma elevada capacidade ociosa, aliada à boa credibilidade do BC tiveram resultado na queda estrutural da inflação.

O Mercado precifica mais reduções de juros à frente. A curva de juros precifica além de um corte de 0,5% em outubro, mais um corte de 0,25% em dezembro. O banco acredita que cortes abaixo de 5% vão depender do comportamento do câmbio e seu potencial impacto na expectativa de inflação para 2020, diferente de outras instituições que já preveem taxa entre 4,75% a 4,50% ao final de 2019. No atual patamar de R\$ 4,15 com reação ao dólar, antes mesmo do próximo corte, e com o lento andamento das reformas, reduções abaixo de 5% podem implicar em riscos para a estabilidade da moeda e pode fazer pouco sentido a taxa cair para subir logo em seguida. Mas vê como positiva a expectativa de uma manutenção da Selic em 5% por um prazo mais longo e também da redução dos juros de mercado de longo prazo. A taxa nominal dos títulos de 10 anos encerrou setembro em 7%, uma significativa redução em relação aos 12% de um ano atrás.



3

Relatório de Investimentos setembro de 2019

A Economia americana segue com dados positivos e afasta receio de recessão. Os dados econômicos dos EUA continuam apontando para um crescimento moderado em 2019. O crescimento do PIB ficou em 2% no 2º trimestre, o desemprego continua nas mínimas históricas e a inflação está dentro da meta do Fed. Apesar dos bons resultados, o Fed reduziu os juros em 0,25% em setembro, considerando uma expectativa de desaceleração devido ao menor comércio internacional. As tensões comerciais com a China permanecem como foco de atenção, e um avanço nas negociações, Esperado para o mês de outubro, pode ser um sinal positivo para a redução do risco de desaceleração. No resto do mundo, preocupação com a redução da atividade continua, evidente na menor produção industrial global. Na Europa, os sinais de desaceleração são bem mais evidentes, devido à queda maior na produção industrial, principalmente na Alemanha. O ECB também promoveu redução de juros em setembro, levando a taxa para -0,5% e anunciando um novo pacote de estímulo monetário via aquisição de títulos no mercado. No entanto, as autoridades monetárias já alertam para a eficácia da política monetária no ambiente de juros negativos e recomenda que os governos promovam mais estímulos fiscais para acelerar a economia. (Fonte: Banco Inter Relatório Publicação Mensal – Comentário Econômico - Setembro/2019)



Relatório de Investimentos setembro 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 (%)					
	30/08/2019	30/09/2019	jul/19	ago/19	set/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 318.824.613,86	R\$ 318.066.367,33	0,5611	0,4974	0,4569	1,5230%	4,6161%	6,2011%
BRASESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 71.509.543,86	R\$ 72.766.706,62	0,9566	0,0100	1,7580	2,7417%	10,1257%	15,3377%
BRASESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 174.465,95	R\$ 167.476,12	0,5429	0,4791	0,4429	1,4720%	4,0359%	NC
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF	R\$ 43.527.428,14	R\$ 43.831.701,83	0,7341	0,2328	0,6990	1,6744%	6,0892%	9,0073%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 50.143.897,89	R\$ 51.244.218,37	0,9545	0,0442	2,1943	3,2154%	14,2251%	23,5386%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 276.130.127,19	R\$ 281.979.447,33	1,1067	(0,1295)	2,1183	3,1148%	14,3772%	18,2983%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 753.883.552,10	R\$ 766.851.279,69	0,9472	0,0349	1,7201	2,7195%	10,0823%	15,2114%
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 83.628.726,76	R\$ 86.712.964,19	1,5132	(0,7875)	3,6880	4,4281%	26,1352%	NC
SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	R\$ 174.770.297,84	R\$ 177.778.244,28	0,9516	0,0310	1,7211	2,7210%	10,0802%	15,1662%
SANTANDER IMA B INST. TP	R\$ 22.609.539,47	R\$ 23.252.720,99	1,2564	(0,4304)	2,8447	3,6886%	4,3267%	NC
BB PREVID TP VII	R\$ 19.155.286,57	R\$ 19.362.325,25	0,8272	0,1736	1,0808	2,0940%	7,8545%	12,0068%
BB PREVID TP IX	R\$ 9.313.380,68	R\$ 9.354.554,84	0,5440	0,4824	0,4421	1,4757%	4,4580%	5,9931%
BB PREVID IDKA 2	R\$ 797.436.422,62	R\$ 808.698.650,13	0,9821	0,0523	1,4123	2,4618%	8,3646%	12,1032%
BB PREVID RF IMA B5+	R\$ 249.201.891,47	R\$ 258.441.015,75	1,4916	(0,7892)	3,7075	4,4237%	26,1398%	NC
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 308.418.915,49	R\$ 310.833.010,81	0,9473	0,3169	0,7827	2,0598%	10,5962%	13,6608%
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 12.347.039,66	R\$ 12.546.121,87	0,8690	0,1161	1,6124	2,6144%	6,5855%	NC
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 51.863.073,56	R\$ 52.767.734,59	0,9244	0,0177	1,7443	2,7030%	5,5355%	NC
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 104.078.547,32	R\$ 107.965.672,22	1,4441	(0,8050)	3,7348	4,3857%	14,4189%	NC
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 61.332.426,84	R\$ 63.154.195,44	1,0471	(0,4751)	2,9703	3,5542%	3,5542%	NC
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 3.408.349.177,27	R\$ 3.465.774.407,65						

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/08/2019	30/09/2019	jul/19	ago/19	set/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPH	R\$ 20.142.367,31	R\$ 20.704.271,77	-	0,7118	2,7897	3,5214%	3,5214%	NC
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO	R\$ 5.573.559,92	R\$ 5.595.162,17	0,5287	0,3982	0,3876	1,3202%	3,9604%	7,3837%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 4.784.761,24	R\$ 4.904.650,32	9,7987	4,3822	2,5056	17,4821%	41,4720%	52,4916%
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 67.946.617,03	R\$ 69.346.004,82	1,3698	1,2356	2,0595	4,7359%	19,3369%	36,4404%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 29.357.711,52	R\$ 30.178.333,54	0,7532	0,2206	2,7953	3,7980%	4,0632%	NC
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 60.141.453,54	R\$ 61.368.682,30	2,2070	0,2323	2,0406	4,5348%	19,7161%	38,2254%
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 76.310.454,70	R\$ 75.947.679,72	4,9465	1,5778	(0,4754)	6,0956%	22,0935%	48,7686%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 107.255.528,42	R\$ 132.275.002,82	3,7509	1,5655	3,4230	8,9821%	21,0433%	NC
SAFRA S&P REAIS	R\$ 11.814.372,96	R\$ 12.071.225,59	1,4545	(1,4524)	2,1741	2,1546%	21,3487%	4,9976%
SAFRA CONSUMO AMERICANO	R\$ 5.766.180,25	R\$ 5.801.697,45	2,1560	5,8659	0,6160	8,8145%	8,8426%	NC
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 148.955.066,54	R\$ 173.962.217,83	2,3203	1,4665	2,6375	6,5591%	29,6301%	NC
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 60.383.291,70	R\$ 61.139.090,60	4,5977	1,9263	1,2517	7,9471%	26,6088%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 598.431.365,13	R\$ 653.294.018,93						
TOTAL GERAL	R\$ 4.006.780.542,40	R\$ 4.119.068.426,58						

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 Vanguarda Dividendos FIA e Itaú Ações Dunamis conforme registrado na Ata 154/2019 COMIV e aprovado pela Diretoria em Despacho de 07/09/2019.

Relatório de Investimentos setembro de 2019

2.2 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXECUTIVO

INSTITUIÇÃO	jul/19	ago/19	set/19
BRADESCO	R\$ 460.600.582,17	R\$ 410.650.990,98	R\$ 411.704.821,84
BANCO DO BRASIL	R\$ 1.077.118.017,44	R\$ 1.075.106.981,34	R\$ 1.095.856.545,97
CAIXA	R\$ 1.220.491.419,23	R\$ 1.217.672.053,24	R\$ 1.241.119.423,90
ITAÚ	R\$ 529.681.814,92	R\$ 552.126.352,15	R\$ 580.424.375,65
SANTANDER	R\$ 293.833.775,70	R\$ 294.684.165,86	R\$ 300.555.303,63
ICATU/BEM DTVM	R\$ 248.269.812,99	R\$ 317.243.727,08	R\$ 347.241.746,51
SAFRA	R\$ 79.060.393,86	R\$ 78.912.980,05	R\$ 81.027.118,48
BTG PACTUAL	R\$ 40.822.530,39	R\$ 60.383.291,70	R\$ 61.139.090,60
TOTAL	R\$ 3.949.878.346,70	R\$ 4.006.780.542,40	R\$ 4.119.068.426,58

Quadro 2

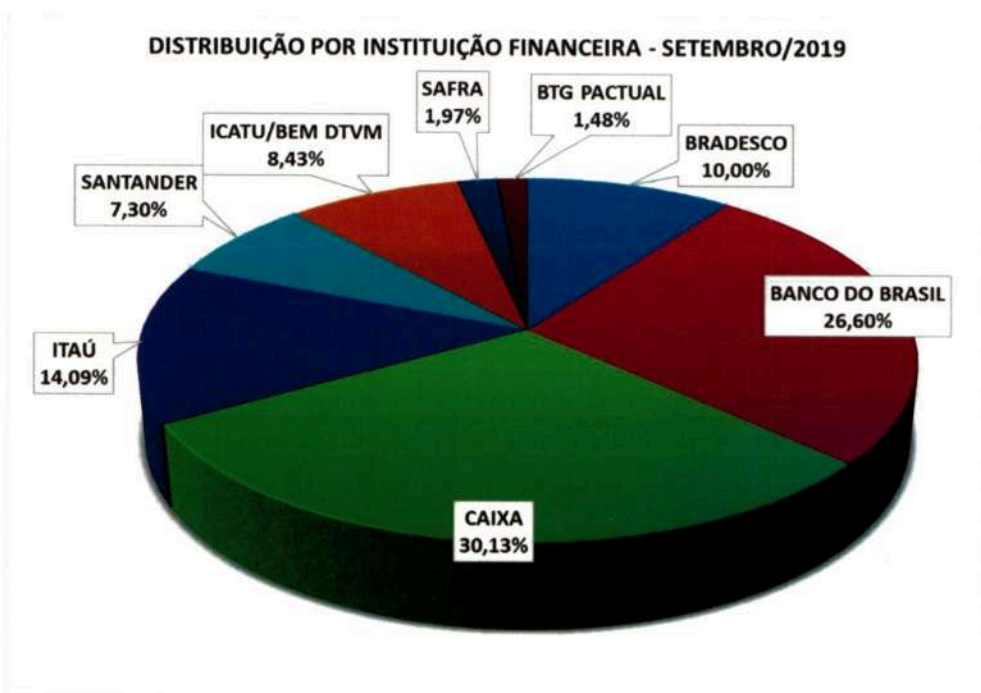


Gráfico 1

[Assinaturas manuscritas]

Relatório de Investimentos setembro de 2019

2.3 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA

FUNDO DE INVESTIMENTO	ÍNDICE DE REFERÊNCIA	SALDO APLICADO	% APLICADO
BRDESCO FI REFER DI PREMIUM BRDESCO FI MAXI PODER PUBLICO	CDI	R\$ 318.233.843,45	7,73%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA SAFRA CONSUMO AMERICANO SAFRA S&P REAIS ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC FI	CDI ATIVO	R\$ 610.685.381,18	14,83%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF SANTANDER IMA B INST. TP	IMA B	R\$ 86.406.916,43	2,10%
BRDESCO 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\$ 1.082.710.087,05	26,29%
BB PREVID IDKA 2 TP RF	IDKA 2	R\$ 808.698.650,13	19,63%
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF BB PREVID RF IMA B5+	IMA B 5+	R\$ 453.119.652,16	11,00%
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\$ 123.792.800,29	3,01%
BRDESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPH	IBR X	R\$ 20.704.271,77	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\$ 614.716.824,12	14,92%
TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO		R\$ 4.119.068.426,58	100%

Quadro 3

DISTRIBUIÇÃO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA - AMAZONPREV

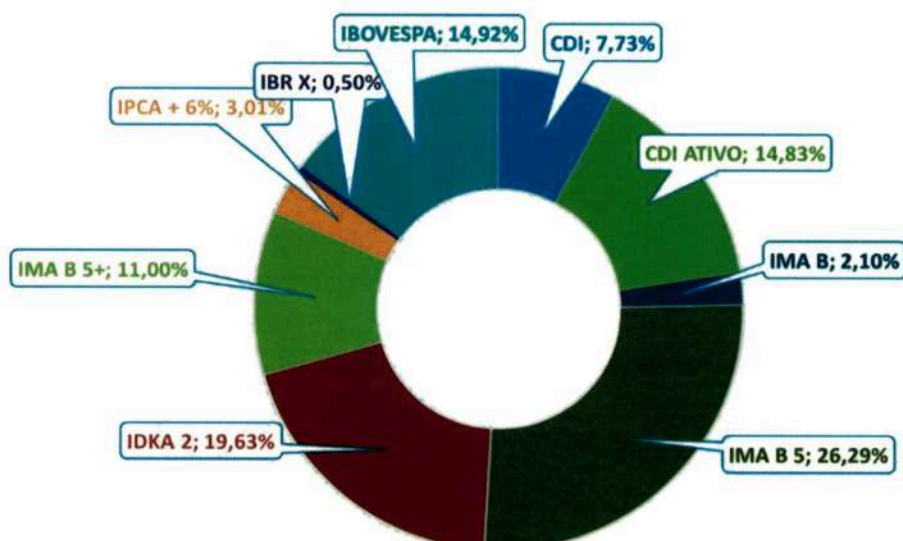


Gráfico 2


 7

Relatório de Investimentos setembro de 2019

2.4 COMPARATIVO DA VALORIZAÇÃO DOS ÍNDICES DE REFERÊNCIA DE MERCADO

ÍNDICE	set/19	ACUMULADO 2019	12 MESES
CDI	0,4600%	4,6600%	6,2700%
IMA-B 5	1,7394%	10,2681%	15,3990%
IMA-B	2,8612%	19,5460%	31,3710%
IMA B 5+	3,7263%	26,5485%	44,8472%
IRF M 1	0,6437%	5,3052%	7,4433%
IDKA 2	1,5951%	9,1342%	12,8478%
IBOVESPA	3,5700%	19,1800%	32,0200%

Quadro 4

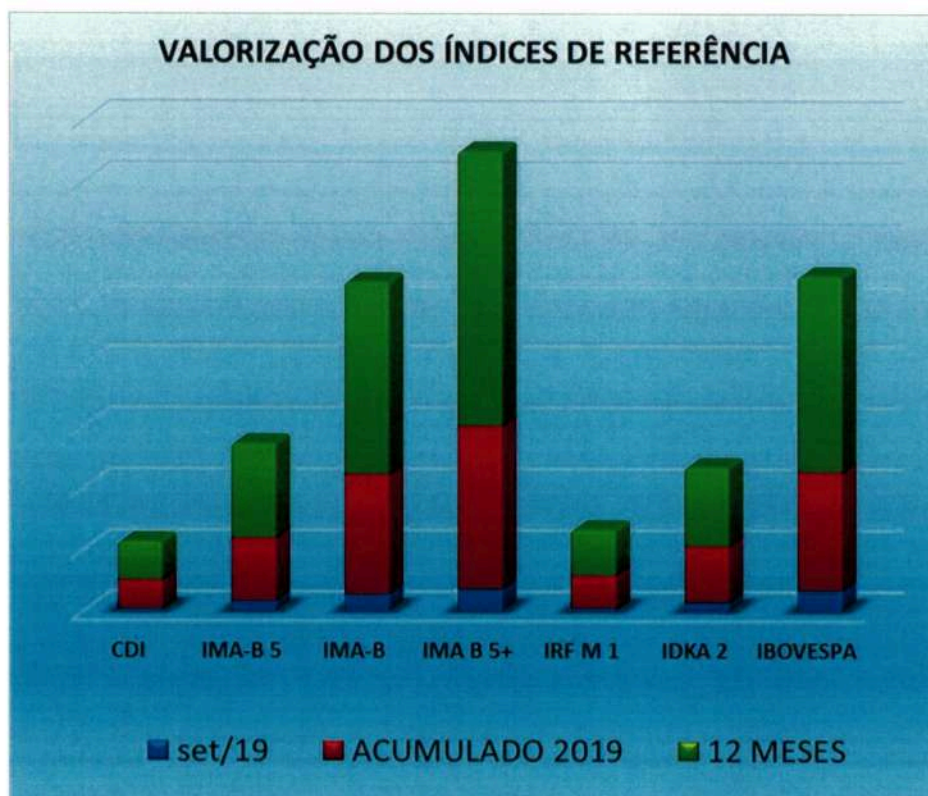


Gráfico 3

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2019	31/09/2019	jul/19	ago/19	set/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 150.848.432,64	R\$ 151.579.121,74	0,715593	0,635173	0,484386	1,8463%	7,4364%	9,5610%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 152.592.212,13	R\$ 153.345.716,47	0,725031	0,644604	0,493803	1,8749%	7,5270%	9,6843%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 155.632.437,25	R\$ 156.437.610,93	0,748638	0,668192	0,517356	1,9465%	7,7540%	9,9932%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 158.082.208,67	R\$ 158.862.847,59	0,725047	0,644619	0,493818	1,8749%	7,5271%	9,6845%
TOTAL GERAL	R\$ 617.155.290,69	R\$ 620.225.296,73						

Quadro 5.

Nota 1: Conforme Deliberação do CODIR de 13/07/2018, com base no Parecer COMIV nº. 2027/2018 de 28/06/2018, foi aprovada a alteração na metodologia de contabilização dos Títulos Públicos que serão mantidos na Carteira até o vencimento, de forma que esses ativos serão registrados pelo valor de custo de aquisição acrescidos dos rendimentos do período. Fica o registro de que a NTN – B remuneram IPCA + Tx de juros contratada no ato da aquisição do ativo (ver quadro 6).


 8

Relatório de Investimentos setembro 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	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO
PREÇO UNITÁRIO DE COMPRA	R\$ 2.314,742871	R\$ 2.288,539269	R\$ 2.235,637189	R\$ 2.254,343911
QUANTIDADE	43.100	43.450	44.113	44.350
APLICAÇÃO INICIAL	R\$ 99.765.417,74	R\$ 99.437.031,23	R\$ 98.620.663,31	R\$ 99.980.152,45
VALOR ATUAL	R\$ 150.848.432,64	R\$ 152.592.212,13	R\$ 155.632.437,25	R\$ 158.082.208,67
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	
	30/08/2019	30/09/2019
CVS - A	R\$ 1.536.705,90	R\$ 1.519.252,58
CVS - B	R\$ 9.943.647,30	R\$ 9.830.669,50
CVS - C	R\$ 199.344,60	R\$ 197.080,52
CVS - D	R\$ 1.090.453,32	R\$ 1.078.063,80
TOTAL	R\$ 12.770.151,12	R\$ 12.625.066,40

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
TOTAL	R\$ 347.818,79	R\$ 1.305.762,48	R\$ 1.653.581,27

Quadro 8

Relatório de Investimentos setembro 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\$ -	R\$ 58.180,96	R\$ 58.180,96	
set/19	R\$ 133.819,20	R\$ 58.180,96	R\$ 192.000,16	
TOTAL	R\$ 482.904,96	R\$ 919.277,12	R\$ 1.402.182,08	

Quadro 9.

2.10 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	30/08/2019	30/09/2019	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.006.780.542,40	R\$ 4.119.068.426,58	85,56%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 617.155.290,69	R\$ 620.225.296,73	12,88%
TÍTULOS CVS	R\$ 12.770.151,12	R\$ 12.625.066,40	0,26%
IMÓVEIS	R\$ 62.060.000,00	R\$ 62.060.000,00	1,29%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 423.077,31	0,01%
TOTAL	R\$ 4.698.765.985,21	R\$ 4.814.401.867,02	100%

Quadro 10.

2.11 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS – FPREV EXECUTIVO

Mês	Recursos FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
set/18	R\$ 3.796.010.936,86	1,67%	13,33%	18,04%
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%

Quadro 11

Relatório de Investimentos setembro de 2019

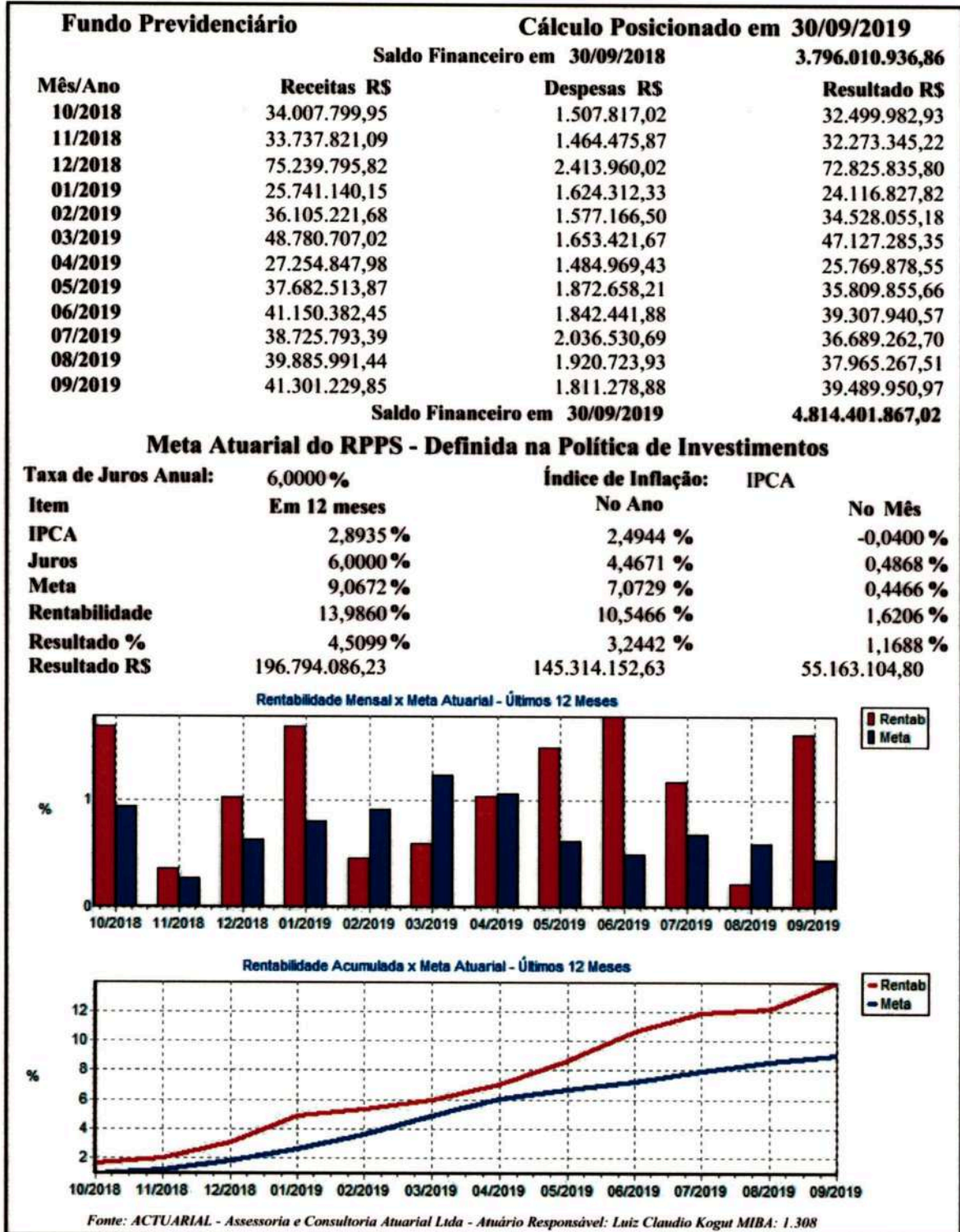
2.12 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo do Amazonas - EXECUTIVO2019

11/10/2019 13:16:18



Quadro 12.

Nota: Receitas = Contribuições Previdenciárias (ativos, aposentados e pensionistas) / Despesas = Folha de Pagamento (aposentados e pensionistas).

Relatório de Investimentos setembro 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						
	30/08/2019	30/09/2019	jul/19	ago/19	set/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 4.717.400,34	R\$ 4.632.008,69	1,1067	(0,1295)	2,1183	3,1148%	14,3771%	18,2983%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 4.654.883,93	R\$ 4.511.804,65	0,9500	0,3169	0,7827	2,0625%	5,6554%	NC	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ -	R\$ 536.618,60	-	-	1,2468	1,2468%	1,2468%	NC	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 20,30							
TOTAL	R\$ 9.372.284,27	R\$ 9.680.452,24							

Quadro 13.

Nota: Conforme Ata 154/2019-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 (%)						
	30/08/2019	30/09/2019	jul/19	ago/19	set/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES	
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.083.723,32	R\$ 2.094.012,80	0,725031	0,644604	0,493803	1,8749%	7,5270%	9,6843%	
TOTAL GERAL	R\$ 2.083.723,32	R\$ 2.094.012,80							

Quadro 14.

3.3 Composição dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS - ALE FPREV	jul/19	ago/19	set/19
SALDO ANTERIOR	11.207.199,38	11.373.542,16	11.456.007,59
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	-	116.326,93	115.124,97
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	166.342,78	(33.861,51)	203.332,48
SAÍDAS FINANCEIRAS	-	-	-
SALDO FINAL	11.373.542,16	11.456.007,59	11.774.465,04

Quadro 15.

3.4 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	30/08/2019	30/09/2019
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 9.372.284,27	R\$ 9.680.431,94
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.083.723,32	R\$ 2.094.012,80
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 20,30
TOTAL	R\$ 11.456.007,59	R\$ 11.774.465,04

Quadro 16.

3.5 Evolução dos Recursos – ALE/FPREV

Mês	Recursos ALE FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
set/18	R\$ 8.992.274,76	3,91%	18,72%	24,11%
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%

Quadro 17.

Relatório de Investimentos setembro de 2019

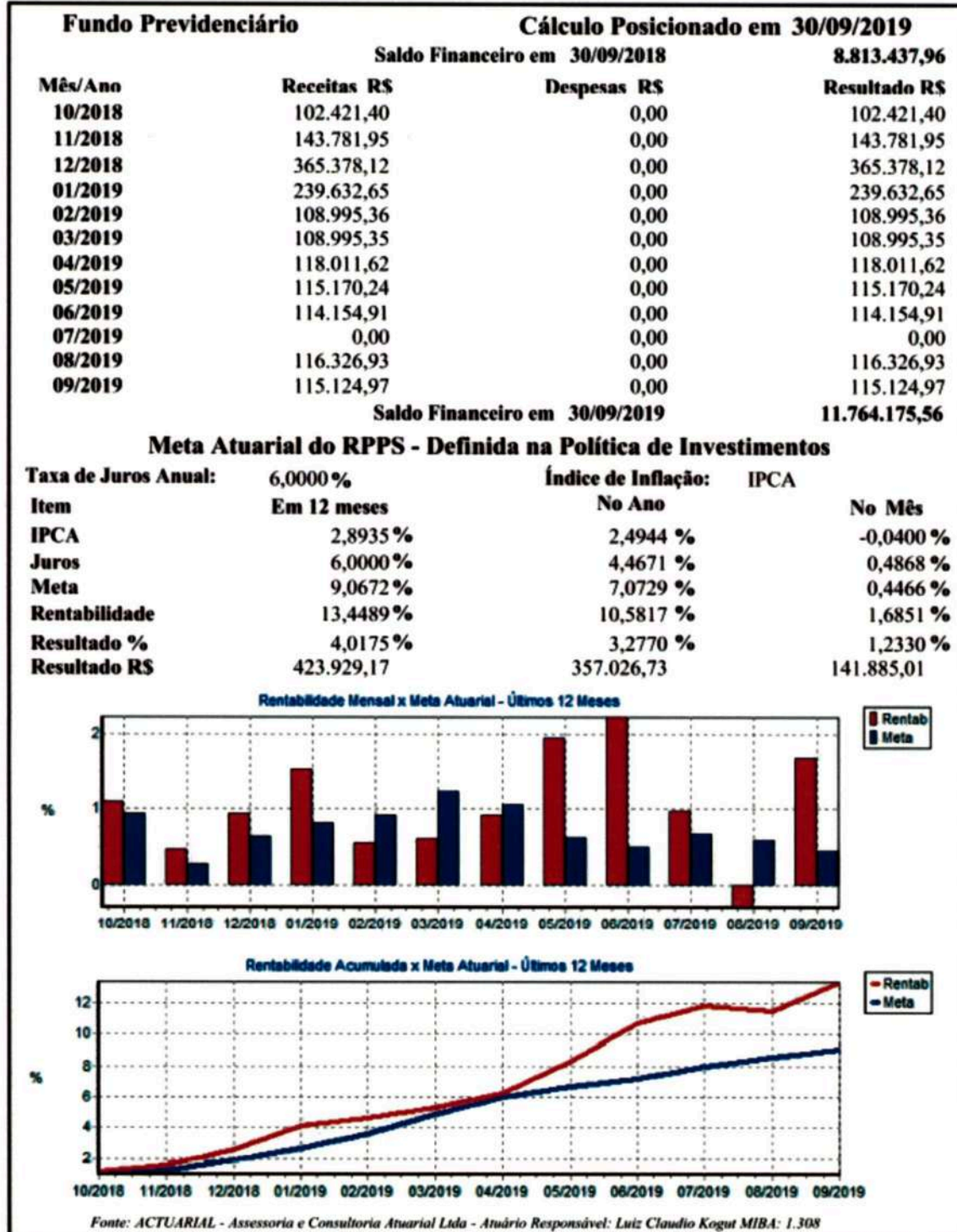
3.6 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo do Amazonas - ASSEMBLEIA2019

11/10/2019 12:45:46



Quadro 18.

Nota 1: Receitas = Contribuições Previdenciárias (ativos, aposentados e pensionistas) / Despesas = Folha de Pagamento (aposentados e pensionistas).

Relatório de Investimentos setembro de 2019

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/08/2019	30/09/2019	jun/19	ago/19	set/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 37.117.014,07	R\$ 40.869.902,67	0,9258	0,1041	1,4811	2,5272%	7,1293%	NC	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+	R\$ 12.180.799,85	R\$ 12.632.401,25	-	(0,7892)	3,7075	2,8890%	2,8890%	NC	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 74.576.462,34	R\$ 79.516.382,68	-	0,0523	1,4123	1,4653%	1,4653%	NC	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 404.208,52	R\$ 1.791,16							
TOTAL	R\$ 124.278.484,78	R\$ 133.020.477,76							

Quadro 19.

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

DESCRIÇÃO	SETEMBRO/2019	ACUMULADO 2019
RENTABILIDADE	1,6489%	7,2139%
META ATUARIAL	0,4466%	7,0729%
RESULTADO ATUARIAL	1,1970%	0,1317%

Quadro 20

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/08/2019	30/09/2019	jun/19	jul/19	ago/19	set/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRABESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 7.265.482,57	R\$ 8.183.757,90	0,2190	0,9566	0,0100	1,7580	2,7417%	2,9667%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 0,00	R\$ 0,00							
TOTAL	R\$ 7.265.482,57	R\$ 8.183.757,90							

Quadro 21.

5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV

DESCRIÇÃO	SETEMBRO/2019	ACUMULADO 2019
RENTABILIDADE DO FPREV	1,9039%	7,1335%
META ATUARIAL	0,4466%	7,0729%
RESULTADO ATUARIAL	1,4508%	0,0566%

Quadro 22.

6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/08/2019	30/09/2019	jun/19	jul/19	ago/19	set/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRABESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 10.397.633,05	R\$ 12.556.825,07	0,8240	0,9566	0,0100	1,7580	2,7417%	3,5883%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 33.652,16							
TOTAL	R\$ 10.397.633,05	R\$ 12.590.477,23							

Quadro 23.

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

Relatório de Investimentos setembro de 2019

6.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV

DESCRIÇÃO	SETEMBRO/2019	ACUMULADO 2019
RENTABILIDADE DO FPREV	1,7212%	5,6141%
META ATUARIAL	0,4466%	4,4638%
RESULTADO ATUARIAL	1,2689%	1,1011%

Quadro 24.

7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/08/2019	30/09/2019	jul/19	ago/19	set/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRDESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 901.761,86	R\$ 1.451.292,56	-	(0,2259)	1,7580	1,5282%	1,5282%	NC	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 448.693,09	R\$ 451.926,58							
TOTAL	R\$ 1.350.454,95	R\$ 1.903.219,14							

Quadro 25.

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

DESCRIÇÃO	SETEMBRO/2019	ACUMULADO 2019
RENTABILIDADE DO FPREV	1,9768%	3,6870%
META ATUARIAL	0,4466%	2,2265%
RESULTADO ATUARIAL	1,5234%	1,4287%

Quadro 26.

Relatório de Investimentos setembro de 2019

8. CONSOLIDADO – FPREV

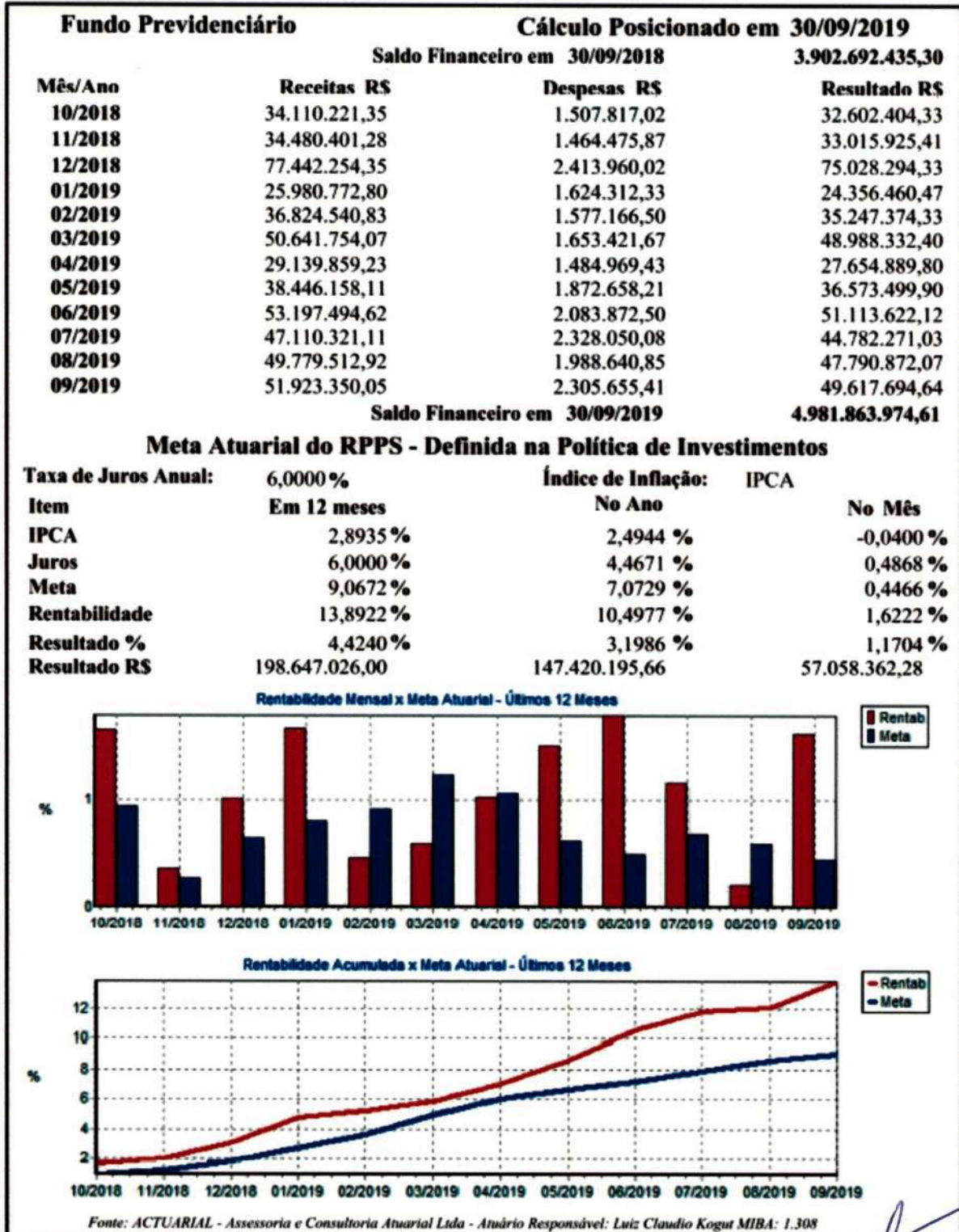
8.2 Quadro Resumo da Rentabilidade 2019 – CONSOLIDADO FPREV AMAZONPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo do Amazonas - CONSOLIDADO2019

14/10/2019 11:42:32



Quadro 27.

Relatório de Investimentos setembro de 2019

9. RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/08/2019	30/09/2019
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	-	2.783.032,18
BRDESCO FIC FI RF ALOC. DINÂMICA - COMPREV	R\$ 11.458.342,50	R\$ 3.707.448,88
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 4.719,34	-
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 1.137,63	R\$ 9.720.176,78
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 350.658,65	R\$ 332.170,15
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1.214.407,46	R\$ 1.757.751,60
TOTAL	R\$ 13.029.265,58	R\$ 18.300.579,59

Quadro 28.

Nota 1: Os valores recebidos de Contribuição Previdenciária no FFIN são utilizados no pagamento das folhas de aposentados e pensionistas dessa massa previdenciária. No mês de setembro/2019, através do Processo 071.000.2627.2019, a Amazonprev utilizou o montante de R\$ 8.000.000,00 (oito milhões de reais) de Compensação Previdenciária – COMPREV para pagamento dessas folhas, conforme solicitado pelo SEFAZ através do Ofício 1449/2019-GSEFAZ, de 24/07/2019.

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

9.2 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/08/2019	30/09/2019
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.060.743,00	R\$ 355.594,24
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 1.060.743,00	R\$ 355.595,24

Quadro 29.

9.3 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/08/2019	30/09/2019
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 196.907,19	R\$ 230.625,52
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 4.229,63	R\$ 41.121,17
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 5.425,65
TOTAL	R\$ 201.137,82	R\$ 277.172,34

Quadro 30.

9.4 Composição do Recursos – ALE FFIN

DESCRIÇÃO	jul/19	ago/19	set/19
SALDO ANTERIOR	R\$ 1.151.717,59	R\$ 690.771,68	R\$ 201.137,82
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	R\$ 184.733,01	R\$ 993.186,16	R\$ 937.433,79
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ 1.422.723,60	R\$ 1.882.228,58	R\$ 1.433.159,86
VARIAÇÃO FINANCEIRA	R\$ 4.124,98	R\$ 1.783,56	R\$ 1.696,03
(-) SAIDAS FINANCEIRAS	-R\$ 2.072.527,50	-R\$ 3.366.832,16	-R\$ 2.296.255,16
SALDO FINAL	R\$ 690.771,68	R\$ 201.137,82	R\$ 277.172,34

Quadro 31.

Relatório de Investimentos setembro de 2019

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/08/2019	30/09/2019
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ 557.019,53
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ -	R\$ 193.062,64
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 191.467,90	R\$ -
TOTAL	R\$ 191.467,90	R\$ 750.082,17

Quadro 32.

10. TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/08/2019	30/09/2019	jul/19	ago/19	set/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.959.523,05	R\$ 2.725.442,60	0,5429	0,4791	0,4429	1,4720%	7,7417%	4,9437%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 40.030.088,61	R\$ 40.878.054,05	1,1067	(0,1295)	2,1183	3,1148%	3,5379%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00						
TOTAL	R\$ 42.989.612,66	R\$ 43.603.497,65						

Quadro 33.

10.2 Taxa de Administração - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/08/2019	30/09/2019	jul/19	ago/19	set/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 651.100,18	R\$ 655.506,39	0,5516	0,4886	0,4508	1,4985%	4,5098%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1.466,44	R\$ 32.283,83						
TOTAL	R\$ 652.566,62	R\$ 655.506,39						

Quadro 34.

10.3 Taxa de Administração - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/08/2019	30/09/2019
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 92.195,32	R\$ 92.195,32
TOTAL	R\$ 92.195,32	R\$ 92.195,32

Quadro 35.

11. OUTROS RECURSOS

11.1 Tribunal de Justiça do Estado - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	30/08/2019	30/09/2019	jul/19	ago/19	set/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO IRF M1 - TJA	R\$ 43.556.642,54	R\$ 32.944.323,00	0,6919	0,5248	0,6212	1,8491%	5,0963%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF M1 TP RF - TJA	R\$ 179.759.857,42	R\$ 183.618.825,79	0,6999	0,5250	0,6268	1,8630%	5,1543%	7,2770%
BB PREV. RF IRF M1 - TJA	R\$ 175.814.061,64	R\$ 179.635.274,23	0,6991	0,5169	0,6193	1,8466%	5,1170%	7,2234%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 10.093,05	R\$ 1.520.335,35						
TOTAL	R\$ 399.140.654,65	R\$ 397.718.758,37						

Quadro 36.



Relatório de Investimentos setembro de 2019

11.2 Composição dos Saldos - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	jul/19	ago/19	set/19
SALDO ANTERIOR	403.111.711,55	403.938.484,46	399.140.654,65
CONTRIB. PREVIDENCIÁRIA	10.023.068,51	5.729.117,90	5.536.233,95
VARIAÇÃO FINANCEIRA	2.796.351,99	2.078.348,28	2.480.957,64
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(11.992.647,59)	(12.605.295,99)	(9.439.087,87)
SALDO FINAL	R\$ 403.938.484,46	R\$ 399.140.654,65	R\$ 397.718.758,37

Quadro 37.

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					
	30/08/2019	30/09/2019	jul/19	ago/19	set/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRABESCO IRF MI - TCE	R\$ 17.338.525,32	R\$ 12.153.928,59	0,6919	0,5248	0,6212	1,8491%	5,0963%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TCE	R\$ 70.521.375,86	R\$ 72.200.786,04	0,6999	0,5250	0,6268	1,8630%	5,1543%	7,2770%
BB PREV. RF IRF MI - TCE	R\$ 68.837.410,37	R\$ 70.501.145,69	0,6991	0,5169	0,6193	1,8466%	5,1170%	7,2234%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 86.478,99	R\$ 812.770,21						
TOTAL	R\$ 156.783.790,54	R\$ 155.668.630,53						

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.

11.4 Composição dos Saldos - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	jul/19	ago/19	set/19
SALDO ANTERIOR	162.089.142,55	160.380.303,38	156.783.790,54
CONTRIB. PREVIDENCIÁRIA	1.708.648,97	2.416.406,61	2.368.358,95
VARIAÇÃO FINANCEIRA	1.121.728,46	830.389,75	972.482,79
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(4.539.216,60)	(6.843.309,20)	(4.456.001,75)
SALDO FINAL	R\$ 160.380.303,38	R\$ 156.783.790,54	R\$ 155.668.630,53

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.

Relatório de Investimentos setembro 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\$ 622.319.309,53	11,27%	11%	100%	100%	art. 7º, inciso I, "a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 250.136.419,92	56,37%	50%	100%	100%	art. 7º, inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 19.362.325,25					
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ 9.354.554,84					
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 271.073.417,00					
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 888.215.032,81					
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 177.778.244,28					
SANTANDER IMA B INST. TP RF LP	R\$ 23.252.720,99					
BRADESCO FI RF IRFM 1 TP	R\$ 45.098.251,59					
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 255.819.611,83					
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 766.851.279,69					
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 86.712.964,19					
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 43.831.701,83					
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 51.244.218,37					
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 52.767.734,59					
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 107.965.672,22					
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 63.154.195,44					
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 6.819.190,19	20,06%	40%	40%	40%	art. 7º, inciso IV, "a"
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 655.506,39					
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 318.066.367,33					
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 94.958.582,15					
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 44.577.351,55					
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 315.344.815,46					
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 327.489.510,07					
ICATÚ VANG. FI RF INFAÇÃO CP LP	R\$ 12.546.121,87					
TÍTULOS CVS	R\$ 12.625.066,40					
TÍTULOS CVS	R\$ 12.625.066,40					
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 4.868.020.165,78	88,16%	ATIVO EM ENQUADRAMENTO	ATIVO EM ENQUADRAMENTO	-	TÍTULO NÃO REGISTRADO NO SELIC

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\$ 20.704.271,77	0,37%	8%	15%	30%	art. 8º, inciso I, "a"
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 61.368.682,30	11,04%	8%	15%	20%	art. 8º, inciso II, "a"
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 4.904.650,32					
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 75.947.679,72					
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 132.275.002,82					
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 174.498.836,43					
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 61.139.090,60					
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 30.178.333,54					
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 69.346.004,82					
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 12.071.225,59					
SAFRA CONSUMO AMERICANO	R\$ 5.801.697,45					
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.595.162,17	0,43%	3%	10%	10%	art. 8º, inciso III
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 653.830.637,53	11,84%				
TOTAL GERAL DA CARTEIRA	R\$ 5.521.850.803,31	100,00%				

Quadro 40.



Relatório de Investimentos setembro 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\$ 250.136.419,92	4,47%	20%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 19.362.325,25	0,35%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ 9.354.554,84	0,17%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 271.073.417,00	4,84%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 888.215.032,81	15,86%	
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 177.778.244,28	3,17%	
BRADESCO FI RF IRFM I TP	R\$ 45.098.251,59	0,81%	
CAIXA FI BRASIL IRF M I TP RF	R\$ 255.819.611,83	4,57%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 766.851.279,69	13,70%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 86.712.964,19	1,55%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 43.831.701,83	0,78%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 51.244.218,37	0,92%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 6.819.190,19	0,12%	
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 655.506,39	0,01%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 318.066.367,33	5,68%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 94.958.582,15	1,70%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 44.577.351,55	0,80%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 20.704.271,77	0,37%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 315.344.815,46	5,63%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 327.489.510,07	5,85%	
SANTANDER IMA B INST. TP RF LP	R\$ 23.252.720,99	0,42%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 61.368.682,30	1,10%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 132.275.002,82	2,36%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 4.904.650,32	0,09%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 75.947.679,72	1,36%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 174.498.836,43	3,12%	
ICATÚ VANG. FI RF INFAÇÃO CP LP	R\$ 12.546.121,87	0,22%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 52.767.734,59	0,94%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 107.965.672,22	1,93%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 61.139.090,60	1,09%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 69.346.004,82	1,24%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 30.178.333,54	0,54%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 12.071.225,59	0,22%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO	R\$ 5.801.697,45	0,10%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 63.154.195,44	1,13%	
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.595.162,17	0,10%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO	R\$ 4.886.906.427,38		
TÍTULOS DO TN	R\$ 622.319.309,53		
IMÓVEIS	R\$ 62.060.000,00		
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 15.417.762,21		
FCVS	R\$ 12.625.066,40		
TOTAL DO RECURSOS	R\$ 5.599.328.565,52		

Base: 30/08/2019

TOTAL DAS APLICAÇÕES DOS RECURSOS	R\$ 5.521.850.803,31
--	-----------------------------

Quadro 41

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

Relatório de Investimentos setembro 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\$ 250.136.419,92	7.803.027.907,11	3,21%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	R\$ 19.362.325,25	674.444.070,06	2,87%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX - 15/08/2018	R\$ 9.354.554,84	94.602.139,76	9,89%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 271.073.417,00	2.952.067.514,60	9,18%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 888.215.032,81	7.885.241.073,51	11,26%	
BRADESCO FI RF IRFM 1 TP	R\$ 45.098.251,59	784.201.361,10	5,75%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 6.819.190,19	340.058.034,73	2,01%	
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 655.506,39	8.990.655.010,19	0,01%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 318.066.367,33	5.933.067.948,78	5,36%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 94.958.582,15	798.353.352,24	11,89%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 44.577.351,55	833.675.084,59	5,35%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 20.704.271,77	193.274.333,51	10,71%	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 255.819.611,83	11.445.572.813,24	2,24%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 766.851.279,69	10.040.403.127,50	7,64%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 86.712.964,19	3.083.627.058,43	2,81%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 43.831.701,83	256.634.236,20	17,08%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 51.244.218,37	209.126.669,61	24,50%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 327.489.510,07	8.195.196.996,57	4,00%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 4.904.650,32	208.784.448,03	2,35%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 315.344.815,46	5.159.078.114,65	6,11%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 61.368.682,30	850.523.628,33	7,22%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 75.947.679,72	1.948.913.317,60	3,90%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 132.275.002,82	3.465.972.947,29	3,82%	
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 177.778.244,28	1.300.830.937,77	13,67%	
SANTANDER IMA B INST. TP RF LP	R\$ 23.252.720,99	1.311.190.600,94	1,77%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 69.346.004,82	761.878.589,02	9,10%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 30.178.333,54	695.040.551,48	4,34%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 174.498.836,43	1.581.305.323,77	11,04%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 52.767.734,59	517.681.504,26	10,19%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 107.965.672,22	1.123.670.921,76	9,61%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 63.154.195,44	1.632.946.396,04	3,87%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 61.139.090,60	1.490.872.974,30	4,10%	
TOTAL	R\$ 4.850.892.220,30			

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\$ 5.595.162,17	278.468.950,50	2,01%	5%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 12.071.225,59	363.107.246,55	3,32%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO	R\$ 5.801.697,45	391.745.357,44	1,48%	
ICATÚ VANG. FI RF INFAÇÃO CP LP	R\$ 12.546.121,87	459.018.350,63	2,73%	
TOTAL	R\$ 36.014.207,08			

TOTAL	R\$ 4.886.906.427,38
--------------	-----------------------------

Quadro 42.

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;

22

Relatório de Investimentos setembro de 2019

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

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

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

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA JUNHO/19) EM R\$ MI	TOTAL RECURSOS - AMAZONPREV (SETEMBRO/2019)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB DTVM S.A	R\$ 1.038.651,62	R\$ 1.438.141.749,82	0,1385%	5%
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 735.269,32	R\$ 584.936.180,30	0,0796%	
BRDESCO	R\$ 577.726,51	R\$ 530.879.520,97	0,0919%	
CAIXA	R\$ 363.323,92	R\$ 1.542.449.098,47	0,4245%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	R\$ 269.771,04	R\$ 300.555.303,63	0,1114%	
BANCO BTG	R\$ 108.550,29	R\$ 61.139.090,60	0,0563%	
BANCO SAFRA	R\$ 100.216,23	R\$ 81.027.118,48	0,0809%	
ICATÚ VANGUARDA DTVM S/A	R\$ 22.948,00	R\$ 347.778.365,11	1,5155%	

Quadro 43.

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

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

Relatório de Investimentos setembro de 2019

13. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS - AMAZONPREV

FPREV PODER EXECUTIVO	SALDO
FUNDO DE INVESTIMENTO FPREV - EXECUTIVO	R\$ 4.119.068.426,58
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 620.225.296,73
TÍTULOS PÚBLICOS - CVS	R\$ 12.625.066,40
IMÓVEIS	R\$ 62.060.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EXECUTIVO	R\$ 423.077,31
TOTAL	R\$ 4.814.401.867,02

ASSEMBLEIA LEGISLATIVA	SALDO
ALE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 9.680.431,94
ALE FPREV TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.094.012,80
ALE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 20,30
ALE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 230.625,52
ALE FFIN DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 5.425,65
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - ALE COBERTURA	R\$ 41.121,17
TOTAL	R\$ 12.051.637,38

PROCURADORIA GERAL DE JUSTIÇA - PGJ/MPE	SALDO
MPE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 133.018.686,60
MPE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1.791,16
MPE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 557.019,53
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - PGJ/MPE - FFIN	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - MPE COBERTURA	R\$ 193.062,64
TOTAL	R\$ 133.770.559,93

DEFENSORIA PÚBLICA - DPE/AM	SALDO
DPE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 8.183.757,90
DPE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
DPE - FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 355.594,24
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - DPE - FFIN	R\$ 1,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - DPE COBERTURA	R\$ -
TOTAL	R\$ 8.539.353,14

TRIBUNAL DE JUSTIÇA - TJ/AM	SALDO
TJ/AM FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 396.198.423,02
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA	R\$ 1.520.335,35
TJ/AM - FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 12.556.825,07
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA - FPREV	R\$ 33.652,16
TOTAL	R\$ 410.309.235,60

TRIBUNAL DE CONTAS DO ESTADO - TCE/AM	SALDO
TCE/AM FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 154.855.860,32
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TCE	R\$ 812.770,21
TCE/AM - FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 1.451.292,56
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TCE/FPREV	R\$ 451.926,58
TOTAL	R\$ 157.571.849,67

OUTROS RECURSOS	SALDO
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO EXECUTIVO	R\$ 43.603.496,65
DISP. FINANCEIRA - TAXA DE ADM. EXECUTIVO	R\$ 1,00
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - ALE	R\$ 655.506,39
DISP. FINANCEIRA - TX DE ADM. ALE	R\$ 32.283,83
DISP. FINANCEIRA - TX DE ADM. TCE	R\$ 92.195,32
FUNDO FINANCEIRO - EXECUTIVO	R\$ 2.783.032,18
FUNDO FINANCEIRO - COMPREV	R\$ 3.707.448,88
DISP. FINANCEIRA - FFIN EXECUTIVO	R\$ 1.757.751,60
DISP. FINANCEIRA - FFIN EXECUTIVO - COBERT. DEFICIT	R\$ 9.720.176,78
DISP. FINANCEIRA - SAL. NÃO RECLAMADOS	R\$ 332.170,15
DISP. REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ -
TOTAL	R\$ 62.684.062,78
TOTAL GERAL	R\$ 5.599.328.565,52

Quadro 44.

Relatório de Investimentos setembro de 2019



Gráfico 4.

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

Relatório de Investimentos setembro de 2019



15. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV EXECUTIVO:	a) Novos Recursos: deverão ser rateados entre os fundos Itaú Ações Dunamis FIC e Icatu Vanguarda Dividendos FIA.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/11/2019
	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	15/11/2019
FPREV ALE:	Novos Recursos: Direcionar 5% (cinco por cento) para o Fundo Icatu Dividendos FIA, rateando o restante entre os fundos Caixa Gestão Estratégica e Itaú Alocação Dinâmica. A estratégia busca obter resultados acima do CDI no Longo Prazo através da gestão ativa desses produtos, conforme sugerido pelo senhor Marcos de Souza com posição favorável dos demais membros do comitê.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/11/2019
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	15/11/2019
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	15/11/2019
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	15/11/2019
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	15/11/2019
Outros Repasses – TCE e TJAM:	Novos recursos: Devido à necessidade de manter enquadrados os recursos da Amazonprev, os novos recursos recebidos pelo TCE e TJAM, devem ser direcionados para os fundos Caixa IRF Brasil M1 e BB Previdenciário IRF M1.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/11/2019
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	15/11/2019
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	15/11/2019
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	15/11/2019
FATOS RELEVANTES 1.	Banco BTG Pactual. 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 45.

Nota: O Plano de Ação Mensal registra atividades a serem desenvolvidas no próximo período até reavaliação do Cenário econômico, com registro em Reunião Ordinária Mensal do Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev e Aprovação da Diretoria. As Estratégias de Alocação apresentadas estão aderentes à Política de Investimentos aprovada para o exercício, e os produtos de investimentos estão devidamente enquadrados aos termos da Legislação Vigente.

C

Relatório de Investimentos setembro 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	1,80%	1,54%	3,03%	2,57%	3,85019	-0,24%	-0,49%
BB PREVID IMA B 5+ TIT PUB RF	6,13%	7,79%	10,29%	12,96%	4,90621	-2,56%	-4,20%
BB PREVID RF IRFM 1 TP	0,24%	0,29%	0,43%	0,51%	3,45044	0,00%	-0,03%
BB PREVID TIT PUB IX FI	0,01%	0,01%	0,04%	0,05%	-15,97526	0,00%	0,00%
BB PREVID TIT PUB VII FI	1,28%	1,52%	2,15%	2,54%	3,83178	-0,17%	-0,52%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	1,84%	2,40%	3,10%	4,01%	4,34117	-0,50%	-1,09%
BRADESCO FEDERAL EXTRA	0,01%	0,01%	0,04%	0,05%	-9,04205	0,00%	0,00%
BRADESCO FI REFER DI PREMIUM	0,02%	0,02%	0,05%	0,00%	-0,90943	0,00%	0,00%
BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL	9,74%	19,94%	16,18%	32,93%	1,48649	-4,37%	-8,04%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	2,14%	2,22%	3,61%	3,71%	4,12573	-0,49%	-0,81%
BRADESCO IRFM 1 TP	0,24%	0,28%	0,43%	0,49%	3,41187	0,00%	-0,03%
BRADESCO MAXI PD PÚBLICO	0,01%	0,01%	0,04%	0,05%	-16,19197	0,00%	0,00%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	11,92%	18,85%	19,70%	31,18%	2,45322	-3,29%	-7,45%
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	0,88%	3,92%	1,48%	6,46%	-0,74849	-2,56%	-2,72%
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	3,06%	5,45%	5,15%	9,02%	2,08439	-3,33%	-3,54%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF	2,08%	2,13%	3,51%	3,57%	4,23460	-0,47%	-0,71%
CAIXA FI BRASIL IMA B5+	6,15%	7,68%	10,33%	12,77%	4,94642	-2,57%	-4,17%
CAIXA FI BRASIL IRFM 1	0,24%	0,28%	0,43%	0,49%	3,75679	0,00%	-0,03%
CAIXA FIA CONSUMO	13,06%	19,06%	21,63%	31,53%	2,43964	-4,25%	-10,18%
CAIXA GESTÃO ESTRATEGICA	2,96%	3,70%	4,99%	6,15%	3,28290	-0,93%	-2,73%
FIC CAIXA CAPITAL PROTEGIDO	0,09%	0,77%	0,17%	1,30%	1,52297	0,00%	-0,10%
ICATU DIVIDENDOS FIA	12,60%	16,43%	20,91%	27,21%	3,16958	-2,76%	-6,99%
ICATU INFLAÇÃO CRÉDITO PRIVADO	1,87%	1,98%	3,16%	3,31%	4,55726	-0,46%	-0,77%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA	2,12%	2,17%	3,57%	3,63%	4,20801	-0,49%	-0,74%
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA	6,21%	7,77%	10,43%	12,92%	4,93959	-2,59%	-4,22%
ITAU AÇÕES PHOENIX FIC FI	12,67%	20,19%	20,88%	33,37%	2,11897	-5,90%	-9,05%
ITAU DUNAMIS FIC	9,94%	18,95%	16,53%	31,32%	2,14962	-3,61%	-9,59%
ITAU FOF RPI AÇÕES	9,73%	18,64%	16,14%	30,80%	1,72455	-3,67%	-9,09%
ITAU INSTIT ALOC DINÂMICA RF FIC	0,67%	2,19%	1,14%	3,65%	3,42005	-0,14%	-1,15%
SAFRA CONSUMO AMERICANO	9,08%	15,66%	14,93%	25,81%	0,52616	-1,42%	-17,03%
SAFRA IMA INST. FI FIC RF	4,60%	5,57%	7,73%	9,26%	3,73841	-1,74%	-3,33%
SAFRA S&P REAIS PB MM	8,18%	15,50%	13,56%	25,53%	-0,02366	-3,69%	-16,71%
SANTANDER AÇÕES TOP SELEÇÃO	9,97%	19,34%	16,54%	31,95%	1,57007	-3,63%	-7,65%
SANTANDER FIC FI IMA B	4,26%	5,19%	7,17%	8,65%	4,80199	-1,64%	-2,73%
SANTANDER FIC IMA-B 5 TIT PUB RF	2,08%	2,13%	3,51%	3,56%	4,21672	-0,47%	-0,71%
SANTANDER IBOVESPA AÇÕES	10,00%	19,86%	16,60%	32,78%	1,33037	-4,83%	-8,80%
CARTEIRA AMAZONPREV	2,63%	2,24%	4,42%	3,74%	3,30875	-0,60%	-1,12%

Quadro 46.

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. Estima-se que os retornos diários da Carteira, em média, se afastam em 6,3407% do retorno diário médio dos últimos



27

Relatório de Investimentos setembro de 2019

12 meses. Como base para comparação, o IRF-M, que tende a ser menos volátil, apresentou um coeficiente de 2,66% no mesmo período. Já o IMA-B, que habitualmente manifesta alta volatilidade, ficou com 5,25% em 12 meses.

Nota 2: VALUE at RISK (95%): Sintetiza a maior perda esperada para a Carteira no intervalo de um dia. Seu cálculo baseia-se na média e no desvio padrão dos retornos diários da Carteira, e supõe que estes seguem uma distribuição normal. Dado o Desempenho da Carteira nos últimos 12 meses, estima-se com 95% de confiança que, se houver uma perda de um dia para o outro, o prejuízo máximo será de 12,2919%. No mesmo período, o IRF-M detém um VaR de 4,38%, e o IMA-B de 8,63%.

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. Analisando os últimos 12 meses, percebe-se que a maior queda ocorrida na Carteira foi de 2,3022%. Já os índices IRFM e IMA-B sofreram quedas de 0,77% e 2,72%, respectivamente.

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.



28

16.2 DETALHAMENTO POR FUNDO DE INVESTIMENTOS

FUNDO DE INVESTIMENTOS	CNPJ	GESTOR	PROCBALANÇO	EMOBIMARK	VALOR	PRAZO DE DURAÇÃO DO ATIVO	PRAZO DE RESGATE	VOLATILIDADE ATRIBUÍDA PELO ADMINISTRADOR DO FUNDO	CONCEITO DA VOLATILIDADE REPRESENTADA	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO
BB PREV FIDCA 2	13.322.226/0001-35	BB DTVM	ART. 7.º, I, "b"	IDCA IPCA 2A	888.215.082,79	INDETERMINADO	D=1	1	RISCO MUITO BAIXO	1,000%
SANTANDER IBOVESPA INSTITUCIONAL AÇÕES	01.699.688/0001-02	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8.º, II, "a"	IBOVESPA	80.178.333,54	INDETERMINADO	D=3	1	RISCO MUITO ALTO	0,750%
BB PREVID FIDC IFRM 1 TP	11.328.862/0001-35	BB DTVM	ART. 7.º, I, "b"	IRF-MI	250.136.419,92	INDETERMINADO	D=1	1	RISCO MUITO BAIXO	2,500%
BRADESCO FI REFER DI PREMIUM	03.399.411/0001-90	BRAM - DTVM	ART. 7.º, IV, "a"	CDI	318.062.967,33	INDETERMINADO	D=0	1	RISCO MUITO BAIXO	0,200%
BRADESCO FI REFER DI MAMI POWER PUB	06.246.263/0001-97	BRAM - DTVM	ART. 7.º, IV, "a"	CDI	6.819.190,19	INDETERMINADO	D=0	1	RISCO MUITO BAIXO	0,200%
BRADESCO FI RENDA FIA REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	03.256.793/0001-00	BRAM - DTVM	ART. 7.º, IV, "a"	CDI	655.506,39	INDETERMINADO	D=1	1	RISCO MUITO BAIXO	0,150%
BRADESCO FI RENDA FIA IFRM 1 TÍTULOS PÚBLICOS	11.464.558/0001-06	BRAM - DTVM	ART. 7.º, I, "b"	IPCA + 6,48% a.a	45.098.251,59	INDETERMINADO	D=0	1	RISCO MUITO BAIXO	0,200%
NTN-B	-	TESOURO NACIONAL	ART. 7.º, I, "a"	IPCA + 6,48% a.a	151.579.121,74	15/05/2023	D=1	1	RISCO MUITO BAIXO	0,000%
NTN-B	-	TESOURO NACIONAL	ART. 7.º, I, "a"	IPCA + 6,90% a.a	155.439.729,26	15/06/2030	D=1	1	RISCO MUITO BAIXO	0,000%
NTN-B	-	TESOURO NACIONAL	ART. 7.º, I, "a"	IPCA + 6,90% a.a	156.437.610,93	15/06/2030	D=1	1	RISCO MUITO BAIXO	0,000%
NTN-B	-	TESOURO NACIONAL	ART. 7.º, I, "a"	IPCA + 6,90% a.a	158.862.847,59	15/06/2040	D=1	1	RISCO MUITO BAIXO	0,000%
COB - A	-	TESOURO NACIONAL	Em enquadramento	0,50% a.m	1.519.252,58	01/01/2027	-	1	RISCO MUITO BAIXO	0,000%
COB - B	-	TESOURO NACIONAL	Em enquadramento	3,12% a.a	9.830.660,50	01/01/2027	-	1	RISCO MUITO BAIXO	0,000%
COB - C	-	TESOURO NACIONAL	Em enquadramento	0,50% a.m	197.080,52	01/01/2027	-	1	RISCO MUITO BAIXO	0,000%
COB - D	-	TESOURO NACIONAL	Em enquadramento	3,12% a.a	1.078.063,80	01/01/2027	-	1	RISCO MUITO BAIXO	0,000%
BB PREVID TIT PUB IX FI	20.734.937/0001-06	BB DTVM	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B	9.354.554,84	INDETERMINADO	D=1	2	RISCO BAIXO	0,200%
BB PREVID TIT PUB VII FI	19.523.395/0001-06	BB DTVM	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B	19.362.325,25	INDETERMINADO	D=1	2	RISCO BAIXO	0,200%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA	10.922.432/0001-03	ICATU VANGUARDIA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B 5	52.767.734,59	INDETERMINADO	D=1	2	RISCO BAIXO	0,400%
CAIXA FI BRASIL IFRM-A1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.740.670/0001-06	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	ART. 7.º, I, "b"	IRF-MI	255.819.611,83	INDETERMINADO	D=0	2	RISCO BAIXO	0,200%
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	26.535.874/0001-09	BRAM - DTVM	ART. 7.º, IV, "a"	IPCA	44.577.351,55	INDETERMINADO	D=4	2	RISCO BAIXO	0,400%
SAFRA S&P REAIS PB MIM	21.996.829/0001-54	SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA	ART. 8.º, III	CDI	32.071.225,59	INDETERMINADO	D=2	2	RISCO BAIXO	0,200%
BRADESCO FI RF IMA B5	20.216.216/0001-04	BRAM - DTVM	ART. 7.º, IV, "a"	IMA-B 5	94.968.502,15	INDETERMINADO	D=0	3	RISCO MÉDIO	0,200%
CAIXA BR GESTÃO ESTRATÉGICA	23.215.097/0001-55	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7.º, IV, "a"	IPCA	327.489.510,07	INDETERMINADO	D=0	3	RISCO MÉDIO	1,600%
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	22.791.028/0001-27	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7.º, I, "a"	IMA-B	43.831.701,83	16/08/2020	-	3	RISCO MÉDIO	1,600%
CAIXA FI BRASIL 2024 V TP RF	22.791.074/0001-26	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B	51.244.218,37	16/08/2024	-	3	RISCO 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	23.452.720,99	INDETERMINADO	D=4	3	RISCO MÉDIO	0,200%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF	11.060.913/0001-10	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B 5	766.851.273,69	INDETERMINADO	D=0	3	RISCO MÉDIO	0,400%
CAIXA FI BRASIL IMA B5+	10.577.593/0001-88	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B 5+	86.172.964,19	INDETERMINADO	D=0	3	RISCO MÉDIO	0,250%
SANTANDER FIC IMA-B 5 TP RF	13.485.117/0001-01	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B 5	177.778.244,28	INDETERMINADO	D=1	3	RISCO MÉDIO	0,250%
BTS ABSOLUTO FIC FIA	11.977.794/0001-64	BTS Practical Asset Management S.A. DTVM	ART. 8.º, II, "a"	IBOVESPA	61.139.090,60	INDETERMINADO	D=33	4	RISCO ALTO	3,000%
CAIXA FIA CONSUMO	10.577.512/0001-79	CAIXA ECONÔMICA	ART. 8.º, II, "a"	ICON	4.904.650,32	INDETERMINADO	D=3	4	RISCO ALTO	0,10% a 0,30%
FIC CAIXA CAPITAL PROTEGIDO	14.386.860/0001-10	CAIXA ECONÔMICA	ART. 8.º, III	IBOVESPA	5.595.162,17	01/10/2020	-	4	RISCO ALTO	0,200%
ICATU DIVIDENDOS FIA	08.279.304/0001-41	ICATU VANGUARDIA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8.º, II, "a"	IBOVESPA	174.688.836,43	INDETERMINADO	D=4	4	RISCO ALTO	0,200%
ICATU INFLAÇÃO CRÉDITO PRIVADO	19.159.727/0001-51	ICATU VANGUARDIA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, VII, "a"	IMA-B 5	12.546.121,87	INDETERMINADO	D=21	4	RISCO ALTO	0,200%
SAFRA CONSUMO AMERICANO FI EM AÇÕES BDR-NÍVEL 1 PB	19.436.818/0001-80	SAFRA S/A	ART. 8.º, III	BDR-1	5.801.697,45	INDETERMINADO	D=4	4	RISCO ALTO	1,500%
BRADESCO FIC AÇÕES INSTITUCIONAL Ibrx ALPHA	14.099.976/0001-78	BRAM - DTVM	ART. 8.º, I, "a"	IBOVESPA	20.704.271,77	INDETERMINADO	D=2	4	RISCO ALTO	0,900%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIA	30.659.168/0001-74	BRAM - DTVM	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B	63.154.195,44	INDETERMINADO	D=4	4	RISCO ALTO	0,200%
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA	10.756.841/0001-06	ICATU VANGUARDIA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, I, "a"	IMA-B 5+	107.965.672,22	INDETERMINADO	D=1	4	RISCO ALTO	0,200%
ITAU INSTIT ALOC DINÂMICA I	21.888.150/0001-49	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 7.º, IV, "a"	IPCA	315.344.815,46	INDETERMINADO	D=1	4	RISCO ALTO	0,200%
BB PREVID TIT PUB IMA B5 +	13.327.340/0001-73	BB DTVM	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B 5+	271.073.417,01	INDETERMINADO	D=1	5	RISCO MUITO ALTO	2,500%
ITAU AÇÕES PHOENIX FIC FI	23.731.629/0001-07	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 8.º, II, "a"	IBOVESPA	75.947.679,72	INDETERMINADO	D=24	5	RISCO MUITO ALTO	1,900%
ITAU DYNAMIS FIC FIA	24.571.992/0001-75	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 8.º, II, "a"	IBOVESPA	132.275.002,82	INDETERMINADO	D=24	5	RISCO MUITO ALTO	1,500%
ITAU FOR RPI AÇÕES	06.872.414/0001-10	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 8.º, II, "a"	IBOVESPA	61.368.602,30	INDETERMINADO	D=5	5	RISCO MUITO ALTO	0,400%
SANTANDER AÇÕES TOP SELEÇÃO	02.486.763/0001-05	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8.º, II, "a"	IBOVESPA	69.346.004,82	INDETERMINADO	D=4	5	RISCO MUITO ALTO	0,500%
TOTAL					5.531.850.809,30					

Quadro 47.

Relatório de Investimentos setembro de 2019

VOLATILIDADE DA CARTEIRA COM BASE NA NOTA DE RISCO DO ADMINISTRADOR

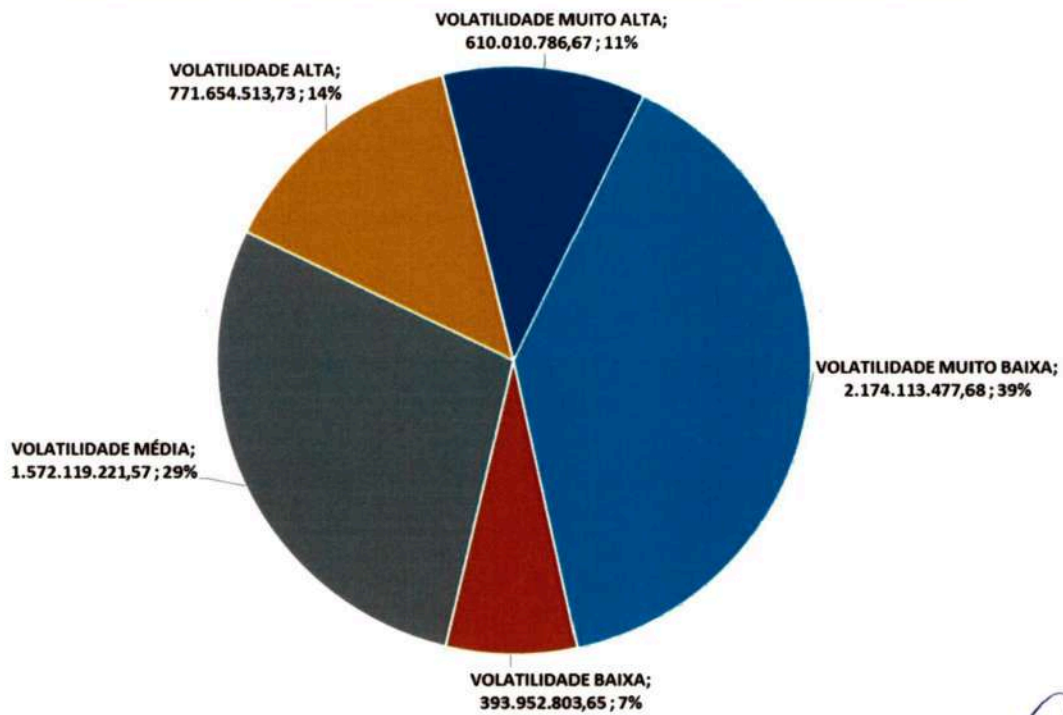


Gráfico 7.

C

[Handwritten signatures]

Relatório de Investimentos setembro de 2019

17. VERIFICAÇÃO DE LASTRO DOS FUNDOS DE RISCO DE CRÉDITO

CRÉDITO INFLAÇÃO

ATUALIZADO EM 30.09.19

TABELA 1 - DURATION & YIELD POR CLASSE

Ativo	Duration	Spread	% PL
DEB	3,00	0,69%	51,1%
CRI	0,00	0,00%	0,0%
LF	2,67	0,42%	17,1%
CDB	1,26	0,50%	3,1%
DPGE	0,00	0,00%	0,0%
NP	0,00	0,00%	0,0%
FIDC	0,00	0,00%	0,0%
NTN-B	4,55	-	27,9%
Over	0,00	-	0,9%
Carteira Crédito	2,84	0,62%	71,2%
Crédito - Contribuição Fundo	0,70	0,44%	71,2%
Fundo (Inclui DAP e NTN-B)	2,77	0,44%	100,0%

TABELA 2 - RATING EXTERNO*

Rating	Financeiro	% PL
AAA	133.954.676	29,2%
AA+	59.586.293	13,0%
AA	69.279.114	15,1%
AA-	12.825.965	2,8%
A+	25.640.523	5,6%
DPGE	0	0,0%
A	2.084.429	0,5%
A-	0	0,0%
BBB+	11.325.826	2,5%
BBB	0	0,0%
BBB-	0	0,0%
BB+	12.332.183	2,7%
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%
Tesouro / Over	132.014.693	28,8%
Total	459.043.702	100,0%

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

TABELA 3 - SETOR

Setor	Financeiro	% PL
Elétrico	102.137.807	22,3%
Bancos	92.619.515	20,2%
Saneamento	34.459.529	7,5%
Holding	15.620.993	3,4%
Óleo e Gás	14.614.871	3,2%
Serviço	14.418.781	3,1%
Shopping Center	11.510.646	2,5%
Varejo	10.538.780	2,3%
Consumo	9.235.764	2,0%
Conc. Rodoviárias	5.898.593	1,3%
Telecom	5.098.440	1,1%
Infraestrutura	4.642.701	1,0%
Mineração	3.211.958	0,7%
Logística	3.020.632	0,7%
Tesouro / Over	132.014.693	28,8%
Total	459.043.702	100,0%

TABELA 4 - EMISSOR

Emissor	Financeiro	% PL
SANEPAR	15.741.669	3,4%
RIO PARANAPANEMA ENERGIA	15.130.192	3,3%
Banco RCJ	15.026.188	3,3%
CPFL Piratininga	14.258.151	3,1%
Eletrobras	13.990.903	3,0%
TAESA	12.639.904	2,8%
Itel	12.535.787	2,7%
CEMIG D	12.332.183	2,7%
LOCALIZA	10.777.191	2,3%
Banco FIDIS	10.657.803	2,3%
LOJAS AMERICANAS	10.538.780	2,3%
SABESP	9.569.533	2,1%
Mercedes Benz	9.420.538	2,1%
NATURA	9.235.764	2,0%
COPASA	9.148.326	2,0%
Bradesco	9.023.431	2,0%
Daycoval	8.249.465	1,8%
COMGÁS	7.507.999	1,6%
MULTIPLAN	7.458.861	1,6%
PETROBRAS	7.106.932	1,5%
Sofisa	6.813.648	1,5%
Alfa	5.664.876	1,2%
Safra	5.302.291	1,2%
TELEFONICA BRASIL	5.098.440	1,1%
Gerdau	4.642.701	1,0%
COPEL	4.467.799	1,0%
TERMOPERNAMBUCO	4.139.496	0,9%
BBM	4.026.640	0,9%
BNB	3.672.552	0,8%
Dasa	3.641.589	0,8%
CPFL GERAÇÃO	3.588.918	0,8%
Celipa	3.327.499	0,7%
Volkswagen	3.306.483	0,7%
VALE	3.211.958	0,7%
Itausa	3.085.206	0,7%
AES TIETE	3.062.909	0,7%
Eletropaulo	3.053.373	0,7%
MRS LOGISTICA	3.020.632	0,7%
ABC Brasil	2.893.886	0,6%
ENEL RJ	2.762.751	0,6%
ECORODOVIAS	2.688.420	0,6%
ENEL CEARÁ	2.409.632	0,5%
Itaú	2.408.940	0,5%
ECOPISTAS	2.177.500	0,5%
Banrisul	2.084.429	0,5%
EDP SAO PAULO	1.879.175	0,4%
Caixa	1.800.428	0,4%
BRMALLS	1.758.749	0,4%
Industrial	1.595.733	0,3%
EDP ESPIRITO SANTO	1.443.725	0,3%
CPFL RGE	1.410.757	0,3%
EQUATORIAL	1.404.903	0,3%
CCR AUTOBAN	1.032.673	0,2%
IGUATEMI	990.622	0,2%
Allianse	962.639	0,2%
COELBA	835.537	0,2%
Votorantim	672.183	0,1%
SONAE SIERRA	339.776	0,1%
Tesouro / Over	132.014.693	28,8%
Total	459.043.702	100,0%

Quadro 48.

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 15 de outubro de 2019, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de setembro/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, e estão integralmente enquadradas aos limites estabelecidos pela Resolução CMN nº. 3.922/2010 e suas alterações.

Manaus – AM, 30 de outubro de 2019.


Alan Nascimento
Coordenador


Bruno Costa Novo
Secretário


Andreza de Souza Silva
Membro

Claudinei Soares
Membro


Leonardo Cavalcanti
Membro


Renizio Ferreira
Membro


Marcos Souza
Membro-ALE


Bruno Barroso
Membro-ALE

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: 30 / 10 / 2019

Membros do Conselho Fiscal:


LIGIA DA SILVA BARROS
Vice-Presidente


MARTHA DUTRA G. DE ALBUQUERQUE
Membro-Titular