



GOVERNO DO ESTADO DO AMAZONAS



AMAZONPREV

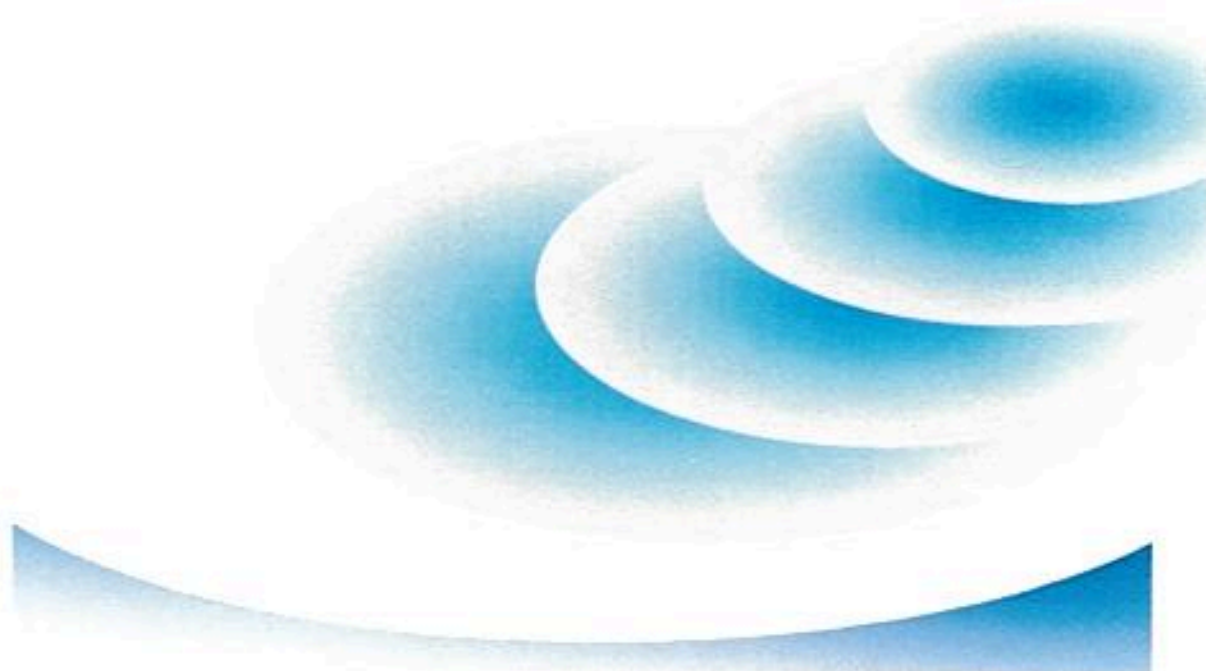
Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



RELATÓRIOS - 2020

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Dezembro / 2020



Destino: DIRAF / PRESI

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

Data: 15/01/2021

RELATÓRIO Nº. 001/2020 – COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **dezembro/2020**, 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 13 a 14)
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (página 15)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (página 16)
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (página 17)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (páginas 18)
- 8) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado – FPREV (página 19)
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro – (páginas 20 a 21)
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 21)
- 11) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 22 a 28)
- 12) Total dos Recursos e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 28 e 29)
- 13) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 30)
- 14) Relatório de Riscos da Carteira (página 31 a 35)
- 15) Parecer do Comitê de Investimentos (página 36).
- 16) Parecer do Comitê de Investimentos (página 37).
- 17) Parecer do Comitê de Investimentos (página 38).



2

1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

Com apoio dos Relatórios: Carta do Gestor e Síntese Mensal, emitidos pela BRAM Asset Management:

Brasil: Copom reforça cenário de estímulos. PIB do 3º trimestre apresentou alta de 7,7%.

Mundo: China continua recuperação. Fed mantém estímulos. Com avanço da pandemia, BCE amplia estímulos.

O Comitê de Política Monetária (Copom) reafirma cenário em que: grau de estímulo elevado é mantido e esclarece condições que modificariam o compromisso de manter a taxa de juros no atual patamar. Em dois documentos divulgados no mês, o Banco Central avaliou a evolução da inflação e da atividade econômica no país e detalhou as projeções e perspectivas para os próximos trimestres. Em ata de reunião na qual a Selic foi mantida em 2,00% a.a., os membros enfatizaram que as condições para manter o compromisso de não elevar a taxa de juros (o “forward guidance”) podem, em breve, não ser mais satisfeitas. Dentre as condições, duas foram destacadas: 1) as expectativas e projeções para a inflação de 2021 e 2) a mudança no horizonte relevante de política monetária. O segundo documento divulgado, o Relatório Trimestral de Inflação, trouxe a abertura da projeção do Banco Central para a inflação, que foi revisada para cima e se situa pouco abaixo da meta para 2021 e próxima à meta para 2022.

Em linhas gerais, os dois documentos reforçam o cenário no qual uma elevação da taxa de juros não acontecerá nos primeiros meses do próximo ano. O movimento dependerá da evolução da atividade e da inflação no começo de 2021, quando os efeitos dos auxílios emergenciais se dissiparão e o nível de mobilidade se recuperará.

O PIB do 3º trimestre de 2020 registrou alta de 7,7% na margem, abaixo das expectativas. Em relação ao mesmo período do ano passado, houve recuo de 3,9%. Na comparação trimestral, pela ótica da demanda, houve crescimento do consumo das famílias (7,6%), do investimento (11,0%) e do consumo do governo (0,9%). Desempenho líquido do setor externo também foi positivo, apesar de queda nas exportações (-2,1%), as importações apresentaram recuo maior (-9,6%). Pela ótica da oferta, apenas a agropecuária apresentou queda (-0,5%). Os setores de serviços avançaram 6,3% e indústria, 14,8%. O resultado do 3º trimestre reflete a flexibilização das medidas de isolamento e retomada das atividades no país.

A atividade econômica avançou em outubro. O Índice do Banco Central de atividade (IBC-Br), indicador prévio do PIB, cresceu 0,9% na margem, refletindo as altas da indústria (1,1%), do comércio (2,1%) e do setor de serviços (1,7%) no mês. Na comparação interanual, o índice mantém queda de 2,6%. O indicador se situa 2,0% abaixo do patamar pré-pandemia. Para 2020, espera-se queda do PIB de 4,5%.

O IPCA de novembro e prévia de dezembro (IPCA-15), mantiveram cenário benigno para a inflação. A inflação de novembro variou 0,89% na margem, acumulando alta de 4,3% nos últimos 12 meses. Já a



prévia da inflação ao consumidor (IPCA-15) de dezembro variou 1,06%, abaixo do esperado, com a média dos principais núcleos, que excluem ou suavizam itens voláteis, variando 0,39%. Em termos anuais, o IPCA-15 acumulado alta de 4,2%, mas os núcleos seguem abaixo da meta do Banco Central, crescendo 2,5% em doze meses. Isso sinaliza um cenário em que a inflação permanece comportada no próximo ano, em especial quando os choques que elevam a inflação corrente se dissiparem.

Nos EUA, o Fed manteve a taxa de juros entre 0% a.a e 0,25% a.a e apontou continuidade dos programas de estímulo (compra de ativos). Como sinalização, o Fed afirmou que manterá o patamar da taxa de juros e o programa de US\$120 bilhões mensais em compra de ativos, até avanço substancial em direção ao alcance das metas de pleno emprego e da estabilidade de preços. As expectativas do Fed para a economia apresentaram melhora na reunião de dezembro. A projeção de contração do PIB americano em 2020 passou de 3,7%, na reunião de setembro, para 2,4% agora. A projeção para o desemprego em 2020 também melhorou, passando de 7,6% para 6,7%. Diante de toda a incerteza oriunda do vírus e do impacto sobre o mercado de trabalho, avalia-se que os estímulos permanecerão por um período prolongado.

Com a ressurgência de casos de Covid-19, Banco Central Europeu (BCE) ampliou políticas de compra de ativos e refinanciamento. O BCE manteve o patamar da taxa de depósito em -0,5%, da taxa de refinanciamento em 0,0% e da taxa de empréstimo em 0,25%. A novidade veio com a ampliação e extensão das políticas de compra de títulos e refinanciamento que o banco já vinha implementando. O Programa Pandêmico de Compras Emergenciais (PEPP na sigla em inglês) foi expandindo em 500 bilhões de euros, chegando à 1,85 trilhões em compra de ativos, e o horizonte de compras foi estendido até março de 2022. O banco também anunciou a ampliação das políticas de refinanciamento de longo prazo (TLTRO III e PELTROs). Na entrevista após a reunião de dezembro, a presidente do BCE, Christine Lagarde, destacou que a segunda onda de COVID-19 e as novas medidas de restrição adotadas para conter a economia podem resultar em contração significativa na região. Por outro lado, a inflação se mantém baixa. Diante desse cenário, Lagarde deixou claro que o BCE segue determinado a manter o grau necessário de política monetária acomodatória.

Indicadores econômicos de novembro da China reforçam a rápida recuperação econômica do país. A produção industrial chinesa cresceu 7,0% em relação a novembro do ano passado, após alta de 6,9% em outubro. Já as vendas no varejo cresceram 5,0% na mesma métrica, uma aceleração frente ao avanço de 4,3% em outubro. Novembro foi o quarto mês consecutivo de alta do comércio, importante indicador da tendência de consumo no país asiático. A China deve manter trajetória de aceleração da retomada, crescendo cerca de 2,5% em 2020.

Perspectiva Renda Fixa – A crise de 2020 foi um desastre em escala global, que afetou todos os países simultaneamente. Os estímulos fiscais e monetários adotados durante a crise têm sido significativos, tanto

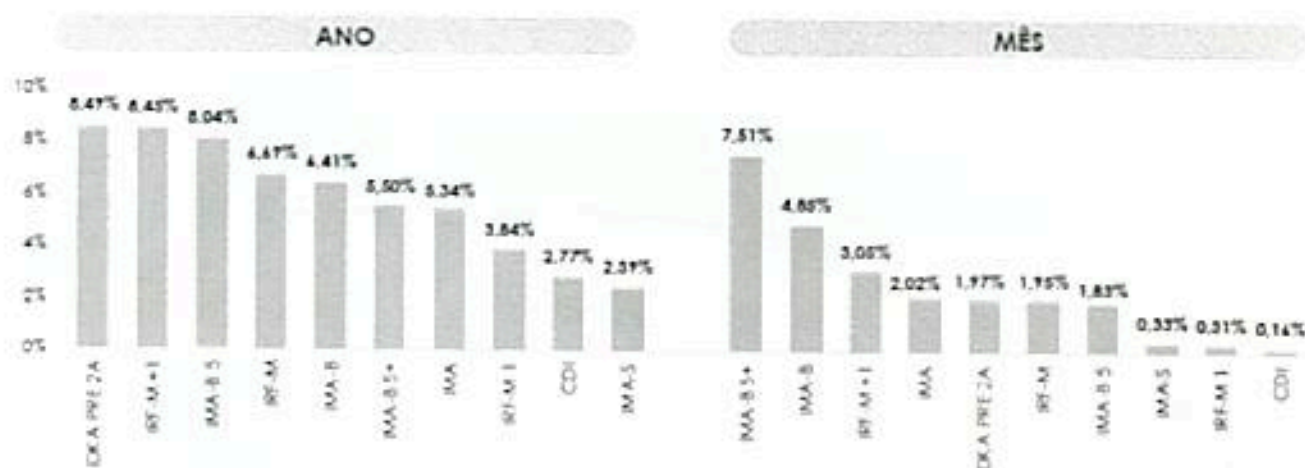


4

em magnitude quanto em utilização de instrumentos, com as transferências diretas de renda às famílias sendo o mais efetivo deles, contribuindo com uma rápida recuperação da atividade econômica global. A expectativa do mercado é de que os principais bancos centrais mantenham as suas políticas monetárias em um campo expansionista por um período prolongado. Isso deve continuar a sustentar a liquidez global. Por fim, os resultados dos testes das vacinas e o início da vacinação trouxeram alívio e otimismo para os mercados nos últimos meses. No cenário local, além dos benefícios trazidos pelos pontos mencionados anteriormente, o noticiário permaneceu mais tranquilo, principalmente do lado fiscal, o que reduziu o risco e contribuiu para a queda dos prêmios ao longo das curvas de juros. Com relação aos estímulos monetários que, por um lado, foram os responsáveis pela recuperação da atividade, apesar de toda a incerteza gerada no entorno do comprometimento fiscal por parte do governo, e por outro, trouxeram consigo uma série de choques inflacionários. Assim, o BC pode deixar de lado a comunicação que adotou este ano, logo após a taxa atingir o mínimo histórico, o motivo é o risco inflacionário.

Novamente, os ativos atrelados à inflação foram os destaques, além de se beneficiarem de uma queda das taxas devido à queda do risco fiscal, tiveram a inflação acima do esperado contribuindo positivamente. Os ativos prefixados também se beneficiaram da queda das taxas de juros em todos os vencimentos e foram o destaque da renda fixa no ano, nos vencimentos mais longos. Os ativos pós fixados, representados pelo IMA S da ANBIMA, se beneficiaram da redução do risco, terminando o mês com resultado de 200% do CDI, porém permanecem no ano com 86,59% do CDI. Por fim, o dólar cedeu 2,532% no mês, fechando dezembro a R\$ 5,1967. No ano, o resultado positivo foi de 28 928%.

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA FIXA



Perspectivas Renda Variável – Dezembro foi mais um mês excelente para as bolsas de valores em geral. A composição do governo dos EUA (mais ao centro), a expectativa de novos estímulos e os avanços das

[Handwritten signatures]

vacinas contra o Covid 19 continuaram a proporcionar ambiente favorável aos ativos de risco. O S&P 500 teve retorno de 3,71%, ampliando o resultado positivo no ano para 16,26 % (em moeda original). O índice Nasdaq teve retorno de 5,65% ampliando o impressionante retorno de 43,64% no ano (em moeda original). O Ibovespa finalmente atingiu a máxima histórica com retorno de 9,30% no mês, encerrando o ano com rentabilidade de 2,92%. A bolsa brasileira tem se destacado positivamente nos últimos meses, refletindo o fluxo expressivo do investidor estrangeiro, o que é justificável também pela sua defasagem quando comparada com as ações de outros países em desenvolvimento e com a grande participação de setores ligados a commodities. Os dados continuam indicando recuperação econômica local, por outro lado, o desafio fiscal e o risco de uma nova onda de Covid 19, agravado de demora na vacinação da população, seguem como os principais riscos. A gestão continua com visão positiva para renda variável no médio e longo prazos, onde pode se destacar fatores como a expectativa de retomada da agenda de reformas do governo, retomada do crescimento do PIB e juros em patamares historicamente baixos, trazendo fluxo do investidor local para a bolsa. Sobre a performance dos diferentes setores, a dinâmica de forte recuperação dos que mais se desvalorizaram neste ano, como Bancos e empresas ligadas a commodities, continuou ao menos parcialmente em dezembro. O inverso ocorreu nos setores de Varejo e Bens de Capital.

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA VARIÁVEL

	DEZEMBRO	2020	12 MESES	24 MESES	36 MESES
IBOVESPA	9,30%	2,92%	2,92%	35,42%	55,78%
SMLL	7,52%	-0,65%	-0,65%	57,16%	69,94%
IBRX 100	9,15%	3,50%	3,50%	38,06%	59,35%
IDIV	8,94%	-1,00%	-1,00%	43,71%	66,63%
S&P 500 (USD)	3,71%	16,26%	16,26%	49,83%	40,49%
MSCI WORLD (USD)	4,14%	14,06%	14,06%	42,79%	27,89%



Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/11/2020	31/12/2020	out/20	nov/20	dez/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 371.157.985,89	R\$ 379.987.948,55	(0,0702)	0,8479	2,3790	3,1746%	5,0890%	5,0896%	
BB PREVID TP VII	R\$ 6.973.809,22	R\$ 7.057.946,27	0,4925	1,1687	1,2064	2,8935%	5,6114%	5,6114%	
BB PREVID IDKA 2	R\$ 174.318.854,51	R\$ 176.978.311,48	-	1,3400	1,5256	2,8860%	2,8860%	2,8860%	
BB PREVID RF IMA B5+	R\$ -	R\$ -	0,2048	2,4941	-	-0,0141%	-2,2459%	NC	
BRANCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 22.942.174,73	R\$ -	(0,2800)	0,7800	-	0,4978%	2,1230%	2,1230%	
BRANCO MANI PODER PÚBLICO	R\$ 501.663,52	R\$ 2.002.164,94	0,0400	0,1200	0,1800	0,3403%	2,1479%	2,1479%	
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 53.380.452,03	R\$ 54.731.103,21	(0,1900)	1,5500	2,5300	3,9214%	6,2951%	6,2951%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 388.404.992,21	R\$ 524.472.731,59	0,1812	1,2878	1,8198	3,3179%	7,7470%	7,7470%	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 521.738.418,36	R\$ 528.628.824,97	(0,1078)	0,8200	1,3207	2,0414%	6,6644%	6,6644%	
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 27.164.971,37	R\$ 27.808.969,52	0,1100	1,3700	2,3700	3,8866%	7,5957%	7,5957%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 77.447.237,65	R\$ 78.849.311,66	0,1500	1,3000	1,8100	3,2882%	7,6461%	7,6461%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 88.190.903,18	R\$ 94.808.812,56	0,1900	2,5500	7,5000	10,4507%	5,1122%	5,1122%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 240.237.103,66	R\$ 64.313.182,31	0,0800	0,1000	0,2000	0,3804%	2,8573%	2,8573%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 57.595.864,08	R\$ 60.799.000,01	(0,2570)	2,1649	5,5614	7,5695%	7,5982%	7,5982%	
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 2.030.054.430,41	R\$ 2.000.438.307,07							
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/11/2020	31/12/2020	out/20	nov/20	dez/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 43.570.386,34	R\$ 44.046.955,17	(1,8585)	8,6135	1,0937	7,7607%	7,7607%	NC	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 94.870.602,82	R\$ 105.039.692,39	2,2240	16,9752	10,7189	32,3940%	5,9800%	5,9800%	
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	R\$ 69.920.316,21	R\$ 70.397.488,98	(1,7371)	2,1010	0,6824	1,0120%	18,2100%	NC	
BRANCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 118.124.682,45	R\$ 128.292.874,16	(2,4640)	8,4500	8,6100	14,8852%	-1,8993%	NC	
BRANCO FIC FIA INSTIT. IBOV ALPHA	R\$ 31.716.107,87	R\$ 34.706.315,56	(0,2117)	13,6600	9,4300	24,1149%	4,6302%	4,6302%	
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 298.456.910,39	R\$ 314.079.521,52	(1,7304)	8,6796	5,2345	12,3894%	13,4580%	13,4580%	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 5.610.091,01	R\$ 5.569.463,88	(0,4100)	(0,6644)	(0,7242)	-1,7881%	-1,7881%	NC	
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 90.782.425,07	R\$ 95.218.278,37	(2,9795)	8,6332	4,8862	10,5466%	-0,5688%	-0,5688%	
ICATU VANGUARD AÇÕES IBX FI	R\$ 25.409.197,65	R\$ 27.767.520,90	(0,6500)	14,8600	9,2800	24,7031%	4,0286%	NC	
ICATU VANGUARD DIVIDENDOS FIA	R\$ 226.889.947,32	R\$ 244.961.155,29	(2,0200)	13,5800	7,9600	20,1440%	-9,4445%	-9,4445%	
ITAÚ AÇÕES DYNAMES FIC	R\$ 162.071.129,66	R\$ 172.274.057,48	0,5000	12,2800	6,3000	19,9504%	-2,4450%	-2,4450%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 9.842.133,19	R\$ 10.665.485,89	(1,3300)	13,7500	8,3700	21,6314%	2,1464%	2,1464%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 118.268.366,68	R\$ 127.693.596,92	(4,1700)	13,9200	7,9700	17,8700%	-21,2167%	-21,2167%	
ITAÚ SMALL CAPS VALUATION	R\$ 51.208.939,43	R\$ 55.061.046,42	(1,4200)	14,9700	7,5200	21,8604%	-8,2331%	NC	
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 67.416.021,48	R\$ 72.548.595,13	(1,9466)	12,6315	7,6133	18,8470%	-6,0818%	-6,0818%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 96.985.492,90	R\$ 104.192.666,47	(1,7365)	13,4405	7,4312	19,7542%	-5,1498%	-5,1498%	
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$ 45.367.831,73	R\$ 48.825.960,46	(1,9452)	12,6529	7,6224	18,8813%	-7,8320%	NC	
SANTANDER GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 60.985.894,73	R\$ 61.275.973,24	(0,6111)	4,3578	0,4756	4,2134%	20,4635%	NC	
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 21.018.315,97	R\$ 21.663.161,65	(2,2950)	10,5849	3,0680	11,3619%	12,5705%	12,5705%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 94.760.875,79	R\$ 95.089.603,00	(1,4289)	2,4433	0,3469	1,3298%	19,0900%	NC	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 79.225.665,18	R\$ 84.713.090,08	(2,0100)	11,6500	6,9300	16,9877%	31,7077%	NC	
OCCAM FIC FIA	R\$ 94.470.410,26	R\$ 104.020.515,68	(0,3100)	11,8900	10,1100	22,8202%	35,5673%	NC	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 31.252.849,09	R\$ 33.658.143,72	(3,5900)	12,9328	7,6962	17,2582%	26,3797%	NC	
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.938.224.593,22	R\$ 2.061.761.182,36							
TOTAL GERAL	R\$ 3.968.279.023,63	R\$ 4.062.199.489,43							

Quadro 1.

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



Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

Nota 2: Com base na Ata COMIV 169/2020, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV, direcionando os novos recursos para o fundo CAIXA FI BRASIL IMA B5;

Nota 3: De acordo com o Parecer nº. 1133/2020-COMIV, registra-se que para o desinvestimento das aplicações, visando cumprir os termos da LC 206/2020 – FTEMP, em novembro/20, foram utilizados os recursos aplicados no fundo Itaú alocação Dinâmica.

Nota 4: Os recursos do fundo Bradesco alocação Dinâmica foram utilizados para o pagamento da folha mensal de aposentados do FPREV Executivo.

2.2 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXECUTIVO

INSTITUIÇÃO	out/20	nov/20	dez/20
BRADERCO	R\$ 165.585.093,24	R\$ 173.284.628,57	R\$ 165.001.374,66
BANCO DO BRASIL	R\$ 836.565.720,74	R\$ 760.811.954,99	R\$ 783.508.342,84
CAIXA	R\$ 992.115.713,69	R\$ 1.054.306.287,67	R\$ 1.203.050.938,14
ITAÚ	R\$ 541.345.927,47	R\$ 581.627.672,62	R\$ 430.007.369,02
SANTANDER	R\$ 244.047.894,12	R\$ 270.755.240,84	R\$ 286.843.195,30
ICATU	R\$ 411.154.773,56	R\$ 445.102.257,17	R\$ 474.195.769,93
SAFRA	R\$ 167.882.731,07	R\$ 173.375.055,84	R\$ 177.551.764,66
BTG PACTUAL	R\$ 280.268.440,80	R\$ 304.067.001,40	R\$ 319.648.985,40
AZ QUEST	R\$ 70.960.848,18	R\$ 79.225.665,18	R\$ 84.713.090,08
OCCAM BRASIL	R\$ 84.434.250,92	R\$ 94.470.410,26	R\$ 104.020.515,68
SULAMÉRICA	R\$ 27.673.836,27	R\$ 31.252.849,09	R\$ 33.658.143,72
TOTAL	R\$ 3.822.035.230,06	R\$ 3.968.279.023,63	R\$ 4.062.199.489,43

Quadro 2.

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXEC
DEZEMBRO - 2020

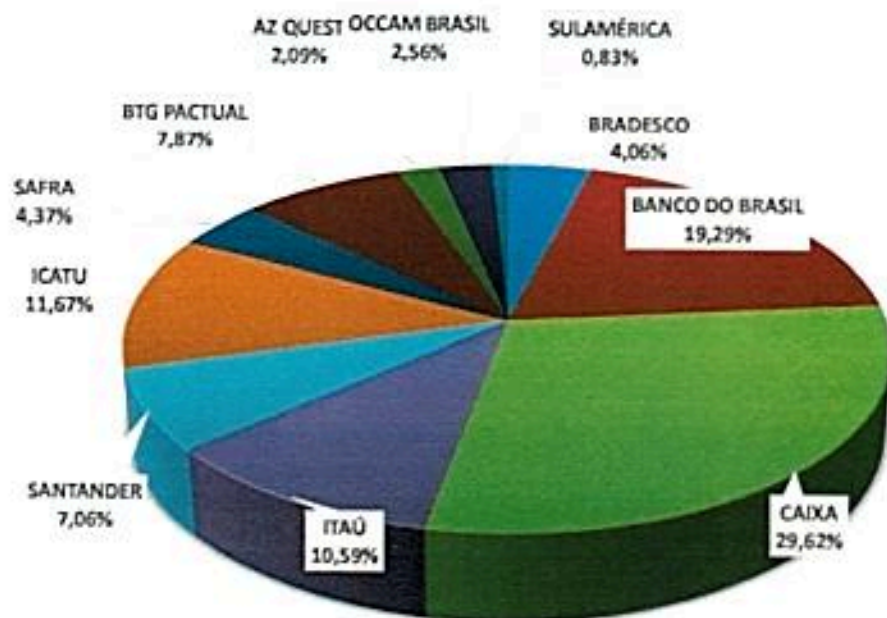


Gráfico 1

(Assinatura)

(Assinaturas)

2.3 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA – FPREV EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	ÍNDICE DE REFERÊNCIA	SALDO APLICADO	% APLICADO
BRASESCO FI MAXI PODER PÚBLICO	CDI	R\$ 2.002.164,94	0,05%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA BB PREVID ALOCAÇÃO ATIVA SAFRA S&P REALS BRASESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	CDI ATIVO	R\$ 994.593.117,48	24,48%
BB PREVID IDKA 2	IDKA 2	R\$ 176.978.311,48	4,36%
ICATU VANG. FI RF INFLA. CP	IMA B 5	R\$ 631.131.012,77	15,54%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	IMA B5+	R\$ 94.808.812,56	2,33%
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF BTG ECONOMIA REAL FIP BB PREVID TP VII	IPCA + 6%	R\$ 67.358.513,36	1,66%
BRASESCO FIC FIA INSTIT IIRX ALPHA ICATU VANGUARD AÇÕES IIRX FI	IIRX X	R\$ 62.473.856,46	1,54%
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA BRASESCO FIA MID SMALL CAPS ITAÚ SMALL CAPS VALUATION CAIXA CONSUMO FI AÇÕES ICATU VANGUARD DIVIDENDOS FIA ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES BTG ABSOLUTO FIQ FIA SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES SANTANDER SELEÇÃO 30 AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA OCCAM FIC FIA SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	IBOVESPA	R\$ 1.701.244.679,98	41,88%
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR BB FIA BDR NÍVEL I	BDR	R\$ 165.487.091,98	4,07%
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC BB MM GLOBAL SELECT	MSCI	R\$ 105.322.928,41	2,59%
TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO		R\$ 4.062.199.489,43	100%

Quadro 3.

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

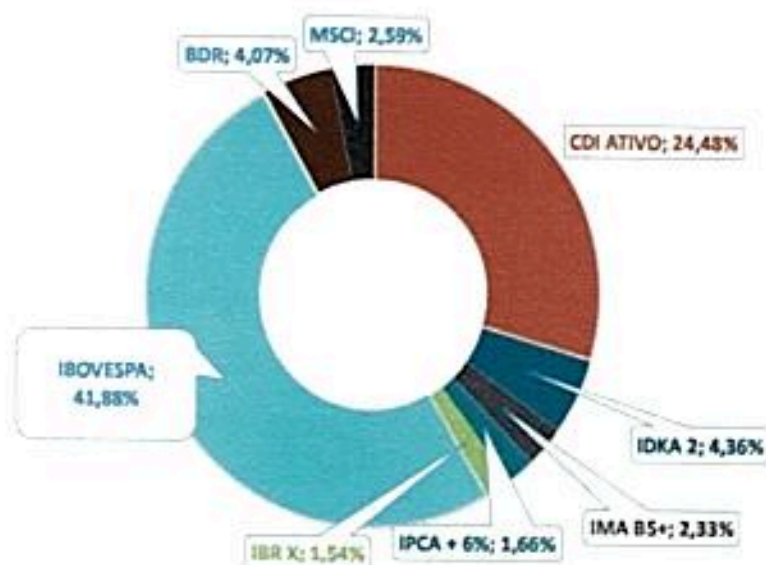


Gráfico 2.

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2020	31/12/2020	out/20	nov/20	dez/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 157.806.300,66	R\$ 160.775.707,36	1,3891	1,4193	1,8817	4,763%	11,2901%	11,2901%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 164.399.373,61	R\$ 167.508.536,39	1,3986	1,4288	1,8912	4,792%	11,4153%	11,4153%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 168.326.589,02	R\$ 171.550.222,13	1,4223	1,4525	1,9151	4,866%	11,7290%	11,7290%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 170.451.846,90	R\$ 173.675.502,75	1,3986	1,4288	1,8912	4,792%	11,4155%	11,4155%
TOTAL GERAL	R\$ 660.984.110,18	R\$ 673.509.968,62						

Quadro 4.

Nota 1: Títulos Públicos atualizados pelo valor de aquisição acrescido da taxa de juros. (Ver quadro 5).

2.6 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

SEGMENTO	Renda Fixa		Renda Fixa	
TIPO DE ATIVO	NTN B		NTN B	
INTERMEDIÁRIO	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\$ 160.775.707,36	R\$ 167.508.536,39	R\$ 171.550.222,13	R\$ 173.675.502,75
DATA DE EMISSÃO	15/01/2014	10/02/2010	10/02/2010	10/02/2010
DATA DA APLICAÇÃO	15/01/2014	15/01/2014	29/01/2014	15/01/2014
DATA DO RESGATE	15/05/2023	15/08/2030	15/08/2030	15/08/2040
TAXA DE JUROS CONTRATADA	6,48%	6,5998%	6,90%	6,60%

Quadro 5.

2.7 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	30/11/2020	31/12/2020
CVS - A	R\$ 1.274.906,10	R\$ 1.257.452,78
CVS - B	R\$ 8.248.980,30	R\$ 8.136.002,50
CVS - C	R\$ 165.383,40	R\$ 163.119,32
CVS - D	R\$ 904.610,52	R\$ 892.221,00
TOTAL	R\$ 10.593.880,32	R\$ 10.448.795,60

Quadro 6.

Nota: Os Títulos CVS realizam amortização mensal dos Juros e antecipação de parte do Principal (quadro a seguir), justificando a redução mensal dos valores em carteira.




2.8 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/20	R\$ 35.286,77	R\$ 145.084,72	R\$ 180.371,49
fev/20	R\$ 34.866,79	R\$ 145.084,72	R\$ 179.951,51
mar/20	R\$ 34.446,81	R\$ 145.084,72	R\$ 179.531,53
abr/20	R\$ 34.026,85	R\$ 145.084,72	R\$ 179.111,57
mai/20	R\$ 33.606,86	R\$ 145.084,72	R\$ 178.691,58
jun/20	R\$ 33.186,90	R\$ 145.084,72	R\$ 178.271,62
jul/20	R\$ 32.766,93	R\$ 145.084,72	R\$ 177.851,65
ago/20	R\$ 32.346,95	R\$ 145.084,72	R\$ 177.431,67
set/20	R\$ 31.926,99	R\$ 145.084,72	R\$ 177.011,71
out/20	R\$ 31.507,01	R\$ 145.084,72	R\$ 176.591,73
nov/20	R\$ 31.087,04	R\$ 145.084,72	R\$ 176.171,76
dez/20	R\$ 30.667,07	R\$ 145.084,72	R\$ 175.751,79
TOTAL	R\$ 395.722,97	R\$ 1.741.016,64	R\$ 2.136.739,61

Quadro 7.

2.9 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2020 (Contrato Regular)			
MÊS	UEA	SEAS	TOTAL
jan/20	R\$ -	R\$ -	R\$ -
fev/20	R\$ -	R\$ -	R\$ -
mar/20	R\$ 58.180,96	R\$ 301.093,20	R\$ 359.274,16
abr/20	R\$ 58.180,96	R\$ -	R\$ 58.180,96
mai/20	R\$ -	R\$ 301.093,20	R\$ 301.093,20
jun/20	R\$ 145.452,40	R\$ -	R\$ 145.452,40
jul/20	R\$ 43.635,72	R\$ 100.364,00	R\$ 143.999,72
ago/20	R\$ 43.635,72	R\$ 200.728,80	R\$ 244.364,52
set/20	R\$ 43.635,72	R\$ -	R\$ 43.635,72
out/20	R\$ 58.180,96	R\$ 100.364,40	R\$ 158.545,36
nov/20	R\$ -	R\$ 200.729,20	R\$ 200.729,20
dez/20	R\$ 159.997,64	R\$ 100.364,40	R\$ 260.362,04
TOTAL	R\$ 610.900,08	R\$ 1.304.737,20	R\$ 1.915.637,28

Quadro 8.

2.10 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	30/11/2020	31/12/2020	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 3.968.279.023,63	R\$ 4.062.199.489,43	84,6697%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 660.984.110,18	R\$ 673.509.968,62	14,0382%
TÍTULOS CVS	R\$ 10.593.880,32	R\$ 10.448.795,60	0,2178%
IMÓVEIS	R\$ 60.353.005,55	R\$ 51.536.297,82	1,0742%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 433.265,68	R\$ 6.430,28	0,0001%
TOTAL	R\$ 4.700.643.285,36	R\$ 4.797.700.981,75	100,00%

Quadro 9.

Nota: Atualizados os valores dos Imóveis, com base em avaliação realizada pela SEINFRA.

2.11 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS – FPREV EXECUTIVO

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
dez/19	R\$ 5.173.977.182,42	4,14%	27,68%	27,68%
jan/20	R\$ 5.215.753.953,85	0,81%	0,81%	25,83%
fev/20	R\$ 5.147.828.344,11	-1,30%	-0,51%	22,61%
mar/20	R\$ 4.677.866.125,22	-9,13%	-9,59%	9,54%
abr/20	R\$ 4.755.324.126,81	1,66%	-8,09%	9,55%
mai/20	R\$ 4.808.084.982,84	1,11%	-7,07%	8,26%
jun/20	R\$ 4.837.475.067,57	0,61%	-6,50%	6,07%
jul/20	R\$ 4.902.116.484,95	1,34%	-5,25%	5,41%
ago/20	R\$ 4.797.635.488,57	-2,13%	-7,27%	2,10%
set/20	R\$ 4.651.365.387,53	-3,05%	-10,10%	-3,39%
out/20	R\$ 4.549.328.612,79	-2,19%	-12,07%	-7,68%
nov/20	R\$ 4.700.643.285,36	3,33%	-9,15%	-5,39%
dez/20	R\$ 4.797.700.981,75	2,06%	-7,27%	-7,27%

Quadro 10.

2.12 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas - AM - EXECUTIVO2020

13/01/2021 12:43:24

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 31/12/2020	
		Saldo Financeiro em 31/12/2019	5.173.977.182,42
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
01/2020	31.251.496,04	2.054.191,64	29.197.304,40
02/2020	49.583.021,72	4.910.443,54	44.672.578,18
03/2020	44.294.358,68	12.998.534,20	31.295.824,48
04/2020	41.873.777,81	100.097.233,40	-58.223.455,59
05/2020	40.614.112,23	116.393.805,63	-75.779.693,40
06/2020	32.820.094,52	156.602.317,41	-123.782.222,89
07/2020	33.058.400,54	124.266.927,34	-91.208.526,80
08/2020	39.455.936,02	99.107.615,94	-59.651.679,92
09/2020	39.934.090,22	109.739.936,23	-69.805.846,01
10/2020	38.961.921,68	112.188.198,10	-73.226.276,42
11/2020	39.697.646,11	116.368.518,74	-76.670.872,63
12/2020	117.527.713,10	175.934.562,52	-58.406.849,42
		Saldo Financeiro em 31/12/2020	4.797.700.981,75
Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos			
Taxa de Juros Anual:	5,8800 %	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	4,5173 %	4,5173 %	1,3500 %
Juros	5,8800 %	5,8800 %	0,4773 %
Meta	10,6630 %	10,6630 %	1,8337 %
Rentabilidade %	4,0860 %	4,0860 %	3,3073 %
Rentabilidade R\$	205.313.515,35	205.313.515,35	155.464.545,81
Resultado %	-5,9433 %	-5,9433 %	+1,4471 %
Resultado R\$	-330.849.239,50	-330.849.239,50	+69.268.220,00

Quadro 11.

Nota 1: Os valores de **Receita** referem-se às contribuições previdenciárias recebidas no período. Os valores de **Despesas** referem-se ao pagamento de inativos e pensionistas do Executivo FPREV, registrados sob Regime de Caixa.

Nota 2: As **Despesas** foram revisadas, os valores referentes aos pagamentos mensais da folha para o FTEMP, a partir de abril/2020, foram atualizados com base nos Controles da GERA/COFIN.




2.13 ACOMPANHAMENTO DE SALDO DO FTEMP

ACOMPANHAMENTO DO SALDO DO FUNDO TEMPORÁRIO - FTEMP						
REFERÊNCIA	APOSENTADO	1ª PARC.13* SALÁRIO APOSENTADO	PENSIONISTA	1ª PARC.13* SALÁRIO PENSIONISTA	TOTAL	SALDO DISPONÍVEL DO FUNDO TEMPORÁRIO (FTEMP)
SALDO INICIAL FTEMP (*)						R\$ 1.088.777.939,69
ABRIL	R\$ 66.682.153,93	-	R\$ 20.836.497,85	-	R\$ 87.518.651,78	R\$ 1.001.259.287,91
MAIO	R\$ 69.474.585,75	-	R\$ 23.937.393,92	-	R\$ 93.411.979,67	R\$ 907.847.308,24
JUNHO	R\$ 79.927.863,30	R\$ 32.729.732,84	R\$ 23.706.524,79	R\$ 13.105.929,44	R\$ 149.470.050,37	R\$ 758.377.257,87
JULHO	R\$ 78.896.538,13		R\$ 23.547.513,10		R\$ 102.444.051,23	R\$ 655.933.206,64
AGOSTO	R\$ 74.224.569,83		R\$ 24.139.168,43		R\$ 98.363.738,26	R\$ 557.569.468,38
SETEMBRO	R\$ 74.267.885,85		R\$ 24.257.910,92		R\$ 98.525.796,77	R\$ 459.043.671,61
OUTUBRO	R\$ 76.164.446,64		R\$ 24.936.928,36		R\$ 101.101.375,00	R\$ 357.942.296,61
NOVEMBRO	R\$ 75.776.269,96		R\$ 25.170.897,70		R\$ 100.947.167,66	R\$ 256.995.128,95
DEZEMBRO	R\$ 73.203.615,51	R\$ 45.076.534,62	R\$ 25.329.272,04	R\$ 10.486.907,93	R\$ 154.096.330,10	R\$ 102.898.798,85
TOTAL ACUMULADO					R\$ 985.879.140,84	

(*) Valor apurado em estudo atuarial efetuado pela empresa ACTUARIAL, em atendimento ao disposto no § 2º do art. 2º da Lei Complementar nº 206 de 16 de abril de 2020

Quadro 12.

Nota: Tabela atualizada com base nos Controles da GERA/COFIN.




Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO- FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO						
	30/11/2020	31/12/2020	set/20	out/20	nov/20	dez/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATEGICA	R\$ 4.987.324,69	R\$ 5.187.064,37	(0,1078)	0,8200	1,3207	2,0414%	6,6644%	6,6644%	
ITAU INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 86.966,82	R\$ 87.142,63	0,0800	0,1000	0,2000	0,3804%	2,8616%	2,8616%	
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 1.897.046,34	R\$ 1.942.019,49	0,1100	1,3700	2,3700	3,8866%	7,5957%	NC	
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 6.971.337,85	R\$ 7.216.226,49							
FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO						
	30/11/2020	31/12/2020	set/20	out/20	nov/20	dez/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 500.643,34	R\$ 540.518,31	(2,0200)	13,5800	7,9600	20,1440%	-9,4445%	-9,4445%	
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 1.529.129,81	R\$ 1.609.171,51	(1,7304)	8,6796	5,2345	12,3894%	8,5851%	NC	
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 223.191,87	R\$ 234.097,57	(2,9793)	8,6332	4,8862	10,5466%	-0,5688%	NC	
OCCAM FIC FIA	R\$ 1.946.297,90	R\$ 2.143.051,03	(0,3100)	11,8900	10,1100	22,8202%	46,8059%	NC	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 1.132.425,14	R\$ 1.136.353,34	(1,4300)	2,4400	0,3500	1,3285%	17,9569%	NC	
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 5.331.688,06	R\$ 5.663.191,96							
TOTAL GERAL	R\$ 12.303.025,91	R\$ 12.879.418,45							

Quadro 13.

Nota: Os Novos Recursos foram direcionados para o fundo CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA.

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/11/2020	31/12/2020	set/20	out/20	nov/20	dez/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.245.024,66	R\$ 2.287.483,14	1,177434	1,398600	1,428769	1,891225	4,7924%	11,4153%	11,4153%
TOTAL GERAL	R\$ 2.245.024,66	R\$ 2.287.483,14							

Quadro 14.

3.3 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE/FPREV	SALDO	
	30/11/2020	31/12/2020
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 12.303.025,91	R\$ 12.879.418,45
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.245.024,66	R\$ 2.287.483,14
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 14.548.050,57	R\$ 15.166.901,59

Quadro 15.

3.4 Evolução dos Recursos – ALE/FPREV

Mês	Recursos ALE FPREV		Evolução		
			Mensal	Anual	12 Meses
dez/19	R\$	12.391.075,09	1,98%	28,40%	28,40%
jan/20	R\$	12.693.470,60	2,44%	2,44%	26,47%
fev/20	R\$	12.745.197,26	0,41%	2,86%	24,93%
mar/20	R\$	12.694.389,88	-0,40%	2,45%	22,39%
abr/20	R\$	12.933.067,87	1,88%	4,37%	15,66%
mai/20	R\$	13.078.781,12	1,13%	5,55%	19,91%
jun/20	R\$	13.459.597,92	2,91%	8,62%	20,10%
jul/20	R\$	13.732.461,93	2,03%	10,83%	20,74%
ago/20	R\$	13.805.725,52	0,53%	11,42%	20,51%
set/20	R\$	13.772.193,11	-0,24%	11,15%	16,97%
out/20	R\$	13.874.434,26	0,74%	11,97%	15,45%
nov/20	R\$	14.548.050,57	4,86%	17,41%	19,73%
dez/20	R\$	15.166.901,59	4,25%	22,40%	22,40%

Quadro 16.

3.5 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas - AM - ASSEMBLEIA/2020

12/01/2021 15:11:49

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 31/12/2020	
Mês/Ano	Recursos R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
01/2020	232.286,40	0,00	232.286,40
02/2020	116.166,02	0,00	116.166,02
03/2020	116.289,97	0,00	116.289,97
04/2020	119.283,88	0,00	119.283,88
05/2020	119.498,47	0,00	119.498,47
06/2020	118.639,37	0,00	118.639,37
07/2020	118.639,37	0,00	118.639,37
08/2020	154.104,87	0,00	154.104,87
09/2020	170.237,76	0,00	170.237,76
10/2020	143.453,76	0,00	143.453,76
11/2020	143.747,84	0,00	143.747,84
12/2020	133.342,71	0,00	133.342,71
Saldo Financeiro em 31/12/2019			12.391.075,09
Saldo Financeiro em 31/12/2020			15.166.901,59
Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos			
Taxa de Juros Anual:	5,8800 %	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	4,5173 %	4,5173 %	1,3500 %
Juros	5,8800 %	5,8800 %	0,4773 %
Meta	10,6630 %	10,6630 %	1,8337 %
Rentabilidade %	8,2804 %	8,2804 %	3,3373 %
Rentabilidade R\$	1.090.136,08	1.090.136,08	485.508,31
Resultado %	-2,1530 %	-2,1530 %	+1,4765 %
Resultado R\$	-313.356,50	-313.356,50	+218.738,76

Quadro 17.

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2020	31/12/2020	out/20	nov/20	dez/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 6.011.932,62	R\$ 7.687.666,70	(0,1078)	0,8200	1,3207	2,0414%	0,9622%	NC
BRAPESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 49.664.165,45	R\$ 50.875.562,47	(0,2800)	0,7800	2,4800	2,9902%	4,6556%	4,6556%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 96.951.318,02	R\$ 99.257.819,70	(0,0702)	0,8479	2,3790	3,1746%	4,9841%	4,9841%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 152.627.416,09	R\$ 157.821.048,87						

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2020	30/11/2020	out/20	nov/20	dez/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRAPESCO FIC FIA INSTIT IIRX ALPHA	R\$ 10.437.137,99	R\$ 11.421.162,23	-	13,6600	9,4300	24,3781%	24,3781%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 10.437.137,99	R\$ 11.421.162,23						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 3.002,10	R\$ -
TOTAL RECURSOS	R\$ 163.067.556,18	R\$ 169.242.211,10

Quadro 18.

Nota: Os Novos Recursos foram direcionados para o fundo CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA.

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - PGJMP2020

13/01/2021 12:39:57

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 31/12/2020	
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
01/2020	2.720.554,80	16.316,13	2.704.238,67
02/2020	1.490.511,62	15.618,19	1.474.893,43
03/2020	1.275.904,25	16.735,98	1.259.168,27
04/2020	1.268.670,97	10.639,28	1.258.031,69
05/2020	1.482.380,96	0,00	1.482.380,96
06/2020	1.273.507,14	10.584,16	1.262.922,98
07/2020	1.272.066,06	11.829,88	1.260.236,18
08/2020	1.482.857,02	9.164,74	1.473.692,28
09/2020	1.514.681,38	7.663,69	1.507.017,69
10/2020	1.490.094,20	9.164,74	1.480.929,46
11/2020	1.503.550,04	9.164,74	1.494.385,30
12/2020	1.579.792,66	12.799,56	1.566.993,10
	Saldo Financeiro em 31/12/2019		142.456.938,05
		Saldo Financeiro em 31/12/2020	169.242.211,10

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos			
Taxa de Juros Anual:	5,8800%	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	4,5173%	4,5173%	1,3500%
Juros	5,8800%	5,8800%	0,4773%
Meta	10,6630%	10,6630%	1,8337%
Rentabilidade %	5,6642%	5,6642%	2,8256%
Rentabilidade R\$	8.560.383,04	8.560.383,04	4.607.661,82
Resultado %	-4,5171%	-4,5171%	+0,9740%
Resultado R\$	-7.547.590,79	-7.547.590,79	+1.617.470,19

Quadro 19

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2020	31/12/2020	out/20	nov/20	dez/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGIA	R\$ 3.833.114,15	R\$ 6.861.925,55	(0,1078)	0,8200	1,3207	2,0414%	0,9622%	NC
BRDESCO INST. ALOC. DINAMICA	R\$ 8.445.660,78	R\$ 8.655.092,79	0,1300	0,7800	2,4800	3,4136%	6,6584%	6,6584%
BRDESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 9.712.269,72	R\$ 9.810.995,35	(0,2800)	1,3000	1,7800	2,8145%	5,8276%	5,8276%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 6.025,14	R\$ -						
TOTAL	R\$ 21.997.069,79	R\$ 25.328.013,69						

Quadro 20.

Nota: Os Novos Recursos foram direcionados para o fundo CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA.

5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Govetto Amazonas / AM - DEFEENSORIA2020

09.12.2020 10:10:53

Fundo Previdenciário

Cálculo Posicionado em 30/11/2020

Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
12/2019	2.476.831,17	0,00	2.476.831,17
01/2020	0,00	0,00	0,00
02/2020	814.914,53	0,00	814.914,53
03/2020	810.969,30	0,00	810.969,30
04/2020	818.197,74	0,00	818.197,74
05/2020	954.963,10	0,00	954.963,10
06/2020	808.818,93	0,00	808.818,93
07/2020	809.559,37	0,00	809.559,37
08/2020	951.659,78	0,00	951.659,78
09/2020	950.378,64	0,00	950.378,64
10/2020	952.657,42	0,00	952.657,42
11/2020	969.890,42	19.728,47	950.161,95
Saldo Financeiro em 30/11/2020			21.997.069,79

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual:	5,8800 %	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	4,3111 %	3,1252 %	0,8900 %
Juros	5,8800 %	5,3771 %	0,4773 %
Meta	10,4446 %	8,6703 %	1,3715 %
Rentabilidade %	5,5132 %	4,5175 %	1,0305 %
Rentabilidade R\$	841.836,84	718.379,89	214.680,43
Resultado %	-4,4651 %	-3,8215 %	-0,3364 %
Resultado R\$	-748.905,64	-657.848,76	-71.037,31

Quadro 21.

6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2020	31/12/2020	out/20	nov/20	dez/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 195.157.016,00	R\$ 204.221.045,98	(0,1078)	0,8200	1,3207	2,0414%	0,9622%	NC
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 50.599.668,72	R\$ 51.803.450,40	(0,0702)	0,8479	2,3790	3,1746%	3,2822%	NC
BB PREV RF IDCA 2	R\$ 138.091.209,36	R\$ 140.197.967,29	-	1,3400	1,5256	2,8360%	2,8360%	NC
BRANCO INST. FIC FI RF IMA B 3	R\$ 42.738.748,66	R\$ 43.418.042,67	0,1300	1,3000	2,4800	3,9472%	8,5929%	8,5929%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RF	R\$ 1.419.431,15	R\$ 1.454.629,62	(0,2800)	0,7800	1,7800	2,2867%	3,4985%	NC
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 428.006.073,89	R\$ 441.095.135,96						

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/10/2020	31/12/2020	out/20	nov/20	dez/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 9.950.014,00	R\$ 10.436.196,24	-	8,6332	4,8860	13,9410%	13,9410%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 9.950.014,00	R\$ 10.436.196,24						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 29.078,79	R\$ -						
TOTAL	R\$ 437.985.166,68	R\$ 451.531.332,20						

Quadro 22.

Nota: Os Novos Recursos foram direcionados para o fundo CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA.

6.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - TRIBUNAL JUSTICA 2020

12/01/2021 15:25:48

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 31/12/2020	
		Saldo Financeiro em 31/12/2019	22.151.234,44
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
01/2020	2.510.168,73	282.187,91	2.227.980,82
02/2020	2.546.041,07	248.112,69	2.297.928,38
03/2020	2.647.202,34	269.053,00	2.378.149,34
04/2020	3.365.431,19	341.730,86	3.023.700,33
05/2020	5.222.844,03	280.083,57	4.942.760,46
06/2020	2.652.044,89	345.842,60	2.306.202,29
07/2020	3.093.956,95	155.165,84	2.938.791,11
08/2020	3.115.630,27	491.741,78	2.623.888,49
09/2020	381.166.785,90	305.986,37	380.860.799,53
10/2020	3.325.215,77	305.986,37	3.019.229,40
11/2020	3.555.836,55	303.719,14	3.252.117,41
12/2020	6.779.546,58	408.928,65	6.370.617,93
		Saldo Financeiro em 31/12/2020	451.531.332,20
Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos			
Taxa de Juros Anual:	5,8800%	Índice de Inflação: IPCA	
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	4,5173%	4,5173%	1,3500%
Juros	5,8800%	5,8800%	0,4773%
Meta	10,6630%	10,6630%	1,8337%
Rentabilidade %	10,2384%	10,2384%	1,6383%
Rentabilidade R\$	13.137.932,27	13.137.932,27	7.175.547,59
Resultado %	-0,3837%	-0,3837%	-0,1919%
Resultado R\$	-529.329,60	-529.329,60	-855.845,10

Quadro 23.

7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/11/2020	31/12/2020	out/20	nov/20	dez/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 41.001.352,53	R\$ 42.064.656,38	(0,1078)	0,8200	1,3207	2,0414%	0,9622%	NC	
BBI PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 50.599.668,72	R\$ 51.803.450,40	(0,0702)	0,8479	2,3790	3,1746%	3,2822%	NC	
BRDESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 7.445.015,81	R\$ 7.577.359,82	0,1300	1,3000	1,7800	3,2372%	7,8511%	7,8511%	
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 99.046.037,06	R\$ 101.445.466,60							

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)							
			30/11/2020	31/12/2020	out/20	nov/20	dez/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIA CONSUMO	R\$	9.950.014,00	R\$	10.436.196,24	-	8,6332	4,8862	13,9412%	13,9412%	NC

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 108.996.051,06	R\$ 111.881.662,84

Quadro 24.

Nota: Os Novos Recursos foram direcionados para o fundo CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA.

7.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - TRIBUNAL CONTAS 2020

09/12/2020 10:21:29

Fundo Previdenciário

Cálculo Posicionado em 30/11/2020

Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
12/2019	205.915,34	0,00	205.915,34
01/2020	696.572,08	0,00	696.572,08
02/2020	445.775,50	0,00	445.775,50
03/2020	245.127,45	0,00	245.127,45
04/2020	770.472,25	0,00	770.472,25
05/2020	446.927,24	0,00	446.927,24
06/2020	447.429,30	0,00	447.429,30
07/2020	522.267,78	0,00	522.267,78
08/2020	522.585,60	0,00	522.585,60
09/2020	99.120.333,45	0,00	99.120.333,45
10/2020	521.775,18	0,00	521.775,18
11/2020	1.032.124,86	0,00	1.032.124,86
Saldo Financeiro em 30/11/2020			108.996.051,06

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual:	5,8800 %	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	4,3111 %	3,1252 %	0,8900 %
Juros	5,8800 %	5,3771 %	0,4773 %
Meta	10,4446 %	8,6703 %	1,3715 %
Rentabilidade %	3,4456 %	3,0184 %	0,6757 %
Rentabilidade R\$	758.293,21	718.106,58	724.664,50
Resultado %	-6,3371 %	-5,2009 %	-0,6864 %
Resultado R\$	-1.490.793,36	-1.308.956,89	-746.141,23

Quadro 25.

8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo Amazonas / AM - CALCULOATUARIAL2020

13/01/2021 12:45:50

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 31/12/2020	
		Saldo Financeiro em 31/12/2019	5.366.939.392,93
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
01/2020	37.411.078,15	2.352.695,68	35.058.382,47
02/2020	54.996.430,46	5.174.174,42	49.822.256,04
03/2020	49.389.851,69	13.284.323,18	36.105.528,51
04/2020	48.215.833,84	100.449.603,54	-52.233.769,70
05/2020	48.840.726,03	116.673.889,20	-67.833.163,17
06/2020	38.120.534,15	153.958.744,17	-115.838.210,02
07/2020	38.874.890,07	124.433.923,06	-85.559.032,99
08/2020	45.682.773,56	99.608.522,46	-53.925.748,90
09/2020	522.856.507,35	110.053.586,29	412.802.921,06
10/2020	45.495.482,41	112.503.349,21	-67.007.866,80
11/2020	46.902.795,82	116.701.131,09	-69.798.335,27
12/2020	129.523.150,14	176.448.361,04	-46.925.210,90
		Saldo Financeiro em 31/12/2020	5.570.851.103,17
Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos			
Taxa de Juros Anual:	5,8800 %	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	4,5173 %	4,5173 %	1,3500 %
Juros	5,8800 %	5,8800 %	0,4773 %
Meta	10,6630 %	10,6630 %	1,8337 %
Rentabilidade %	4,2704 %	4,2704 %	3,1307 %
Rentabilidade R\$	229.243.959,91	229.243.959,91	170.539.134,43
Resultado %	-5,7766 %	-5,7766 %	+1,2737 %
Resultado R\$	-343.198.267,21	-343.198.267,21	+70.652.416,34

Quadro 26.

Nota 1: Os valores de Receita referem-se às contribuições previdenciárias recebidas no período. Os valores de Despesas referem-se ao pagamento de inativos e pensionistas.

Nota 2: As Despesas foram revisadas, os valores referentes aos pagamentos mensais da folha para o FTEMP, a partir de abril/2020, foram atualizados com base nos Controles da GERA/COFIN.

9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/11/2020	31/12/2020
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.555.452,07	R\$ 56.320.916,20
FUNDO BRADESCO FIC FI RF ALOC. DINÂMICA - COMPREV	R\$ 5.126.783,44	R\$ 5.325.299,78
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 0,02	R\$ 0,02
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 34.841,70	R\$ 34.817,75
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 148.299,19	R\$ 213.938,35
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 9.966,16
TOTAL	R\$ 6.865.377,42	R\$ 61.904.938,26

Quadro 27.

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

9.2 Fundo Previdenciário Militares

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/11/2020	31/12/2020
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R\$ 1.799,35	R\$ 5.120.613,59
BRADESCO DI PREMIUM - FPPM	R\$ -	R\$ 8.914.604,45
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R\$ 6.703,84	R\$ -
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FTEMP	R\$ -	R\$ -
BRADESCO DI PREMIUM - FTEMP	R\$ 409.179,84	R\$ 410.063,48
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ 13.389.643,45	R\$ 504.124,99
TOTAL	R\$ 13.807.326,48	R\$ 14.949.406,51

Quadro 28.

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

9.3 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/11/2020	31/12/2020
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ 313.673,83
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 369,81	R\$ -
TOTAL	R\$ 369,81	R\$ 313.673,83

Quadro 29.



9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2020	31/12/2020
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 396.004,26	R\$ 234.524,35
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 42.257,24	R\$ 2.075,42
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 438.261,50	R\$ 236.600,77

Quadro 30.

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2020	31/12/2020
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 627.524,18	R\$ 1.141.738,91
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ 198.120,93	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 565.981,40
TOTAL	R\$ 825.645,11	R\$ 1.707.720,31

Quadro 31.

9.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2020	31/12/2020
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 6.276.740,51	R\$ 10.450.301,46
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	R\$ 530.499,98	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 6.807.240,49	R\$ 10.450.301,46

Quadro 32.

9.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2020	31/12/2020
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 13.195.315,77	R\$ 7.545.184,36
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 13.195.315,77	R\$ 7.545.185,36

Quadro 33.

10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2020	31/12/2020	out/20	nov/20	dez/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.575.883,01	R\$ 1.930.353,60	0,0400	0,1200	0,1800	0,3403%	2,1455%	2,1455%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 40.496.120,74	R\$ 37.008.399,35	(0,1078)	0,8200	1,3207	2,0414%	6,6644%	6,6644%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00						
TOTAL	R\$ 41.774.638,52	R\$ 38.938.753,95						

Quadro 34.

10.2 Taxa de Administração - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2020	31/12/2020	out/20	nov/20	dez/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.265.312,65	R\$ 1.302.358,29	0,0400	0,1200	0,1800	0,3403%	2,1455%	2,1455%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 1.265.312,65	R\$ 1.302.358,29						

Quadro 35.

10.3 Taxa de Administração - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2020	31/12/2020	out/20	nov/20	dez/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 853.757,20	R\$ 855.317,71	0,0400	0,1200	0,1800	0,3403%	2,1455%	2,1455%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 853.757,20	R\$ 855.317,71						

Quadro 36.

10.4 Taxa de Administração – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2020	31/12/2020	out/20	nov/20	dez/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.422.836,66	R\$ 1.875.237,11	0,0400	0,1200	0,1800	0,3403%	2,1455%	2,1455%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 2.422.836,66	R\$ 1.875.237,11						

Quadro 37.

Nota: Transferido o valor de R\$ 1.000.000,00 (um milhão de reais) para a conta operacional dos recursos da Taxa de Administração (20.400-5 Bradesco) em 22/12/20, para pagamento das despesas administrativas dessa Amazonprev.

10.5 Taxa de Administração – PGJ/MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2020	31/12/2020	out/20	nov/20	dez/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 754.759,98	R\$ 756.139,54	0,0400	0,1200	0,1800	0,3403%	0,3703%	0,3703%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 754.759,98	R\$ 756.139,54						

Quadro 38.

11. ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS

11.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
TÍTULOS DO TN	R\$ 675.797.451,76	11,96%	10%	100%	art. 7º, inciso I, "a"
TOTAL art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 675.797.451,76				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 7.057.946,27	34,87%	10%	100%	art. 7º, inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 317.176.278,77				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 524.472.731,59				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 54.731.103,21				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 831.659.583,30				
ICATU VANG INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 78.849.311,66				
ICATU VANG INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 94.808.812,56				
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 60.799.000,01				
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 1.969.554.767,37				
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 89.848.523,89	15,47%	30%	40%	art. 7º, inciso IV, "a"
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 60.806.397,84				
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 66.310.584,66				
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 582.852.669,05				
ITAU INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 64.400.324,94				
BRADERCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 9.324.667,93				
TOTAL art. 7º, inciso IV, "a"	R\$ 873.543.168,31				
ICATU VANG FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 29.750.989,01	0,53%	5%	5%	art. 7º, inciso VII, "b"
TOTAL art. 7º, inciso VII, "b"	R\$ 29.750.989,01				
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 3.548.646.376,45	62,83%			

Quadro 39.

11.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Variável

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BRDESCO INST IRR X ALPHA	R\$ 46.127.497,29	1,31%	10%	30%	art. 8º, inciso I, "a"
ICATU VANGUARDA AÇÕES IRR FI	R\$ 27.767.520,90				
TOTAL art. 8º, inciso I, "a"	R\$ 73.895.018,69				
ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 10.665.485,89	30,57%	30%	30%	art. 8º, inciso II, "a"
BRDESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 128.292.874,16				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 109.039.692,39				
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 116.324.768,42				
ITAU INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 127.693.596,92				
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 172.274.057,48				
ITAU SMALL CAP VALUATION	R\$ 55.061.046,42				
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 245.501.673,60				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 315.688.693,03				
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 104.192.666,47				
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO 30	R\$ 48.825.960,46				
SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 72.548.595,13				
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 84.713.090,08				
OCCAM FIC FIA	R\$ 106.163.566,71				
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 33.658.143,72				
TOTAL art. 8º, inciso II, "a"	R\$ 1.726.643.910,88				
SAFRA S&P REALS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 21.663.161,64	0,38%	1%	3%	art. 8º, inciso III
TOTAL art. 8º, inciso III	R\$ 21.663.161,64				
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 5.569.463,88	0,10%	1%	5%	art. 8º, inciso IV, "a"
TOTAL art. 8º, inciso IV, "a"	R\$ 5.569.463,88				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.827.771.555,09	32,36%			

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 44.046.955,17	1,86%	2,5%	10%	art. 9º, inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXTERIOR	R\$ 61.275.973,24				
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 70.397.488,98	2,95%	2,5%		art. 9º, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 96.225.946,54				
TOTAL art. 9º - A	R\$ 271.946.373,93				
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 271.946.373,93	4,81%			
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 5.648.364.305,47	100,00%			

Quadro 40.

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% CARTEIRA	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 7.057.946,27	0,12%	20%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 317.176.278,77	5,55%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 582.852.669,05	10,20%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 105.039.692,39	1,84%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 70.397.488,98	1,23%	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 44.046.955,17	0,77%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 524.472.731,59	9,18%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 54.731.103,21	0,96%	
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 89.848.523,89	1,57%	
BRANCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 9.324.667,93	0,16%	
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 60.806.397,84	1,06%	
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 66.310.584,66	1,16%	
BRANCO INST IBR X ALPHA	R\$ 46.127.497,79	0,81%	
BRANCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 128.292.874,16	2,25%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 64.400.324,94	1,13%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 831.659.583,30	14,56%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 10.665.485,89	0,19%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 172.274.057,48	3,02%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 55.061.046,42	0,96%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 116.324.768,42	2,04%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 127.693.596,92	2,24%	
ICATÚ VANGUARD DIVIDENDOS FIA	R\$ 245.501.673,60	4,30%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 29.750.989,01	0,52%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 78.849.311,66	1,38%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 94.808.812,56	1,66%	
ICATÚ VANGUARD AÇÕES IBX FI	R\$ 27.767.520,90	0,49%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 315.688.693,03	5,53%	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 5.569.463,88	0,10%	
SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 72.548.595,13	1,27%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 104.192.666,47	1,82%	
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$ 48.825.960,46	0,85%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 61.275.973,24	1,07%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 21.663.161,64	0,38%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 60.799.000,01	1,06%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 96.225.956,54	1,68%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 84.713.090,08	1,48%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 106.163.566,71	1,86%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 33.658.143,72	0,59%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO	R\$ 4.972.566.853,71		

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 – Dezembro/2020

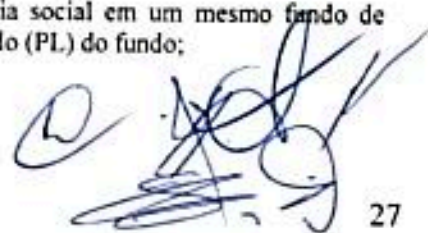
11.3 Enquadramento III – Limites Gerais – art. 14º - Res. CMN 3922/10

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14	TOTAL APLICADO	CNPJ	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL DO FUNDO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	R\$ 7.057.946,27	19.523.305/0001-06	R\$ 245.861.748,76	2,87%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 317.176.278,77	13.322.205/0001-35	R\$ 8.476.640.994,51	3,74%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 582.852.669,05	25.078.994/0001-90	R\$ 9.568.490.825,39	6,09%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 105.039.692,39	29.258.294/0001-38	R\$ 1.169.052.019,30	8,99%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 70.397.488,98	21.470.644/0001-13	R\$ 647.569.267,65	10,87%	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 44.046.955,17	17.413.636/0001-68	R\$ 1.391.937.780,06	3,16%	
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 89.848.523,89	08.246.263/0001-97	R\$ 422.999.839,93	21,24%	
BRANCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 9.324.667,93	03.399.411/0001-90	R\$ 3.168.557.239,02	0,29%	
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 60.806.397,84	20.216.216/0001-04	R\$ 954.945.016,55	6,37%	
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 66.310.584,66	28.515.874/0001-09	R\$ 1.422.915.185,87	4,66%	
BRANCO INST IBR X ALPHA	R\$ 46.127.497,79	14.099.976/0001-78	R\$ 595.178.322,17	7,75%	
BRANCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 128.292.874,16	06.988.623/0001-09	R\$ 2.180.561.264,94	5,88%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 524.472.731,59	11.060.913/0001-10	R\$ 20.761.505.098,56	2,53%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 54.731.103,21	22.791.074/0001-26	R\$ 223.356.568,60	24,50%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 831.659.583,30	23.215.097/0001-55	R\$ 14.722.139.597,34	5,65%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 116.324.768,42	10.577.512/0001-79	R\$ 773.737.678,54	15,03%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 64.400.324,94	21.838.150/0001-49	R\$ 3.882.685.363,65	1,66%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 10.665.485,89	08.817.414/0001-10	R\$ 970.856.600,60	1,10%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 127.693.596,92	23.731.629/0001-07	R\$ 1.462.115.658,32	8,73%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 172.274.057,48	24.571.992/0001-75	R\$ 3.595.641.284,57	4,79%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 55.061.046,42	01.063.897/0001-65	R\$ 1.248.048.647,45	4,41%	
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO 30	R\$ 48.825.960,46	29.549.642/0001-26	R\$ 1.729.254.395,74	2,82%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 72.548.595,13	02.436.763/0001-05	R\$ 601.590.009,52	12,06%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 104.192.666,47	01.699.688/0001-02	R\$ 714.586.579,89	14,58%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 61.275.973,24	17.804.792/0001-50	R\$ 1.055.348.442,07	5,81%	
ICATU VANGUARD DIVIDENDOS FIA	R\$ 245.501.673,60	08.279.304/0001-41	R\$ 1.793.128.513,73	13,69%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 78.849.311,66	10.922.432/0001-03	R\$ 872.184.819,46	9,04%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 94.808.812,56	10.756.541/0001-06	R\$ 924.231.847,02	10,26%	
ICATU VANGUARD AÇÕES IBOV FI	R\$ 27.767.520,90	06.224.719/0001-92	R\$ 130.863.906,84	21,22%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 60.799.000,01	30.659.168/0001-74	R\$ 1.813.956.117,79	3,35%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 315.688.693,03	11.977.794/0001-64	R\$ 2.636.774.357,29	11,97%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 96.225.956,54	19.436.818/0001-80	R\$ 1.875.936.369,20	5,13%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 84.713.090,08	34.791.108/0001-61	R\$ 1.917.361.908,11	4,42%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 106.163.566,71	11.628.883/0001-03	R\$ 1.060.739.165,08	10,01%	
SUL AMERICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 33.658.143,72	11.458.144/0001-02	R\$ 1.012.301.864,05	3,32%	
TOTAL	R\$ 4.915.583.239,18				

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14, § 1º	TOTAL APLICADO	CNPJ	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Resolução CMN nº 3.922/2010
SAFRA S&P REAIS PH FIC MULTIMERCADO	R\$ 21.663.161,64	21.595.829/0001-54	R\$ 734.034.454,86	2,95%	5%
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 5.569.463,88	35.640.811/0001-31	R\$ 361.122.940,75	1,54%	
ICATU VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 29.750.989,01	19.719.727/0001-51	R\$ 825.779.381,34	3,60%	
TOTAL	R\$ 56.983.614,53				
TOTAL	R\$ 4.972.566.853,71				

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;



Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

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

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

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

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

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA NOVEMBRO/2020) EM R\$ M1	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (DEZEMBRO/2020)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB DTVM S/A	R\$ 1.150.595,34	R\$ 1.126.571.030,63	0,0979%	5%
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 733.407,35	R\$ 430.094.511,65	0,0586%	
BRDESCO	R\$ 526.725,22	R\$ 400.710.546,27	0,0761%	
CAIXA	R\$ 400.300,08	R\$ 1.527.188.186,52	0,3815%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	R\$ 293.673,11	R\$ 286.843.195,30	0,0977%	
BANCO BTG	R\$ 131.091,90	R\$ 321.258.156,91	0,2451%	
BANCO SAFRA	R\$ 105.781,36	R\$ 178.688.118,19	0,1689%	
SULAMERICA INVESTIMENTOS	R\$ 29.614,03	R\$ 33.658.143,72	0,1137%	
ICATU VANGUARDA DTVM S/A	R\$ 29.345,73	R\$ 476.678.307,73	1,6244%	
AZ QUEST INVESTIMENTOS	R\$ 16.296,64	R\$ 84.713.090,08	0,5108%	
OCCAM BRASIL GESTÃO	R\$ 14.171,91	R\$ 106.163.566,71	0,7491%	

Quadro 43.

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

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

DISTRIBUIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR GESTOR DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS

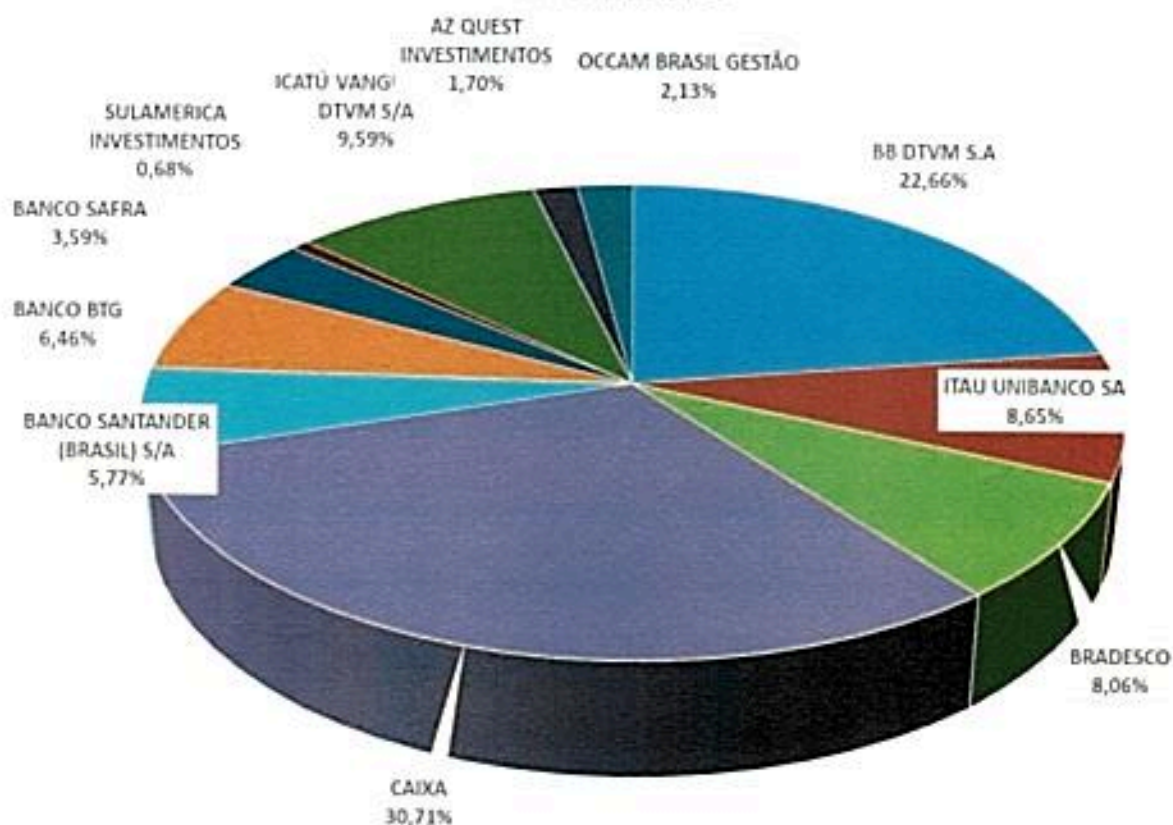


Gráfico 4.

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$	4.972.566.853,72
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$	675.797.451,76
TÍTULOS - CVS	R\$	10.448.795,60
IMÓVEIS	R\$	51.536.297,82
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$	1.337.337,37
TOTAL	R\$	5.711.686.736,27

Quadro 44.

EVOLUÇÃO DOS RECURSOS - AMAZONPREV



Gráfico 5.

Nota: Com base nos termos da LC 206/2020 que, dentre outros, cria o Fundo Temporário - FTEMP a partir dos recursos de contribuição dos servidores militares do FPREV, com finalidade de pagamento dos inativos e pensionistas do FFIN e do FPPM. O valor total a ser utilizado no FTEMP é de R\$ 1,088 bilhão, que dessa forma reduzirá os resultados da carteira de investimentos da Amazonprev.

13. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV EXECUTIVO:	Novos Recursos: Direcionar para o fundo Schroder e IDKA 2 BB	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2021
	Demais Recursos:		
	Caixa Consumo: resgatar 30 MM tratar entre Schroder e IDKA BB		
	SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES: resgate 20 MM direcionar STDG GLOBAL		
	Itaú Dividendos: direcionar 30 MM para BB Global		
FPREV ALE:	Novos Recursos: Direcionar para o Safrá Consumo	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2021
FPREV MPE/PGJ:	Novos Recursos: Direcionar para o fundo BB Global	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2021
	Migrar R\$ 20 MM BB Alocação ativa para BB Ações Valor	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2021
FPREV - DPE/AM	Novos Recursos: Direcionar para o Fundo CAIXA Gestão Estratégica	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2021
FPREV - TJA/AM	Novos Recursos: Direcionar para o fundo BB Global	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2021
	Migrar R\$ 40 MM BB Alocação ativa para o BB Global e BB IDKA 2		
FPREV - TCE/AM	Novos Recursos: Direcionar para o fundo BB Global	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2021
FFIN (Executivo, ALE, TCE, TJA, MPE, DPE)	Aplicar os recursos no fundo Bradesco Maxi Poder Público, facilitando a operacionalização dos pagamentos das folhas de inativos e pensionistas desses órgãos. Devem ser observados os limites para aplicação conforme legislação vigente.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2021
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	15/02/2021
DISPONIBILIDADES DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	Os Novos Recursos repassados pelo Poder Executivo, devem ser aplicados no fundo Maxi Poder Público, direcionando o residual, se houver, para o Fundo Caixa Gestão Estratégica. Aos valores repassados pelos demais órgãos serão mantidas as aplicações atuais. Havendo necessidade, a GERA/COFIN pode solicitar transferência de valores da Caixa para o Bradesco.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2021

Quadro 45.

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





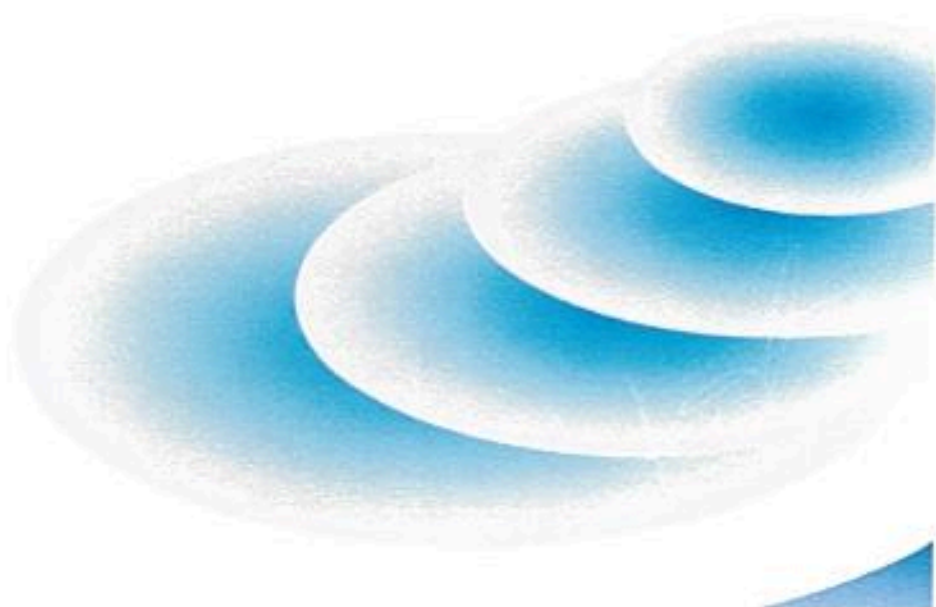

AMAZONPREV

Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



RELATÓRIOS - 2020

RELATÓRIO DE RISCOS FPREV - AMAZONPREV



Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

SALDOS E PERFORMANCE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO - FPREV AMAZONPREV	TOTAL APLICADO	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	Máx Drawdown 12M	12M	dez20	2020
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Prev RF Alocação Ativa Fcfl	R\$ 382.852.669,05	6,25%	0,64%	-5,49	5,09%	2,38%	5,09%
BB Prev RF Tr Publ VII FI	R\$ 7.057.946,27	2,43%	0,25%	-2,66	5,61%	1,21%	5,61%
Bradesco Fc FI RF Alocação Dinâmica	R\$ 60.985.284,88	6,90%	0,71%	-5,88	4,66%	2,48%	4,66%
Bradesco Inst FICFI RF Im B 5	R\$ 60.806.397,84	5,37%	0,55%	-5,66	7,86%	1,78%	7,86%
Bradesco FI RF Maxi Poder Público	R\$ 2.002.164,94	0,32%	0,03%	-0,55	2,15%	0,18%	2,15%
Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	R\$ 54.731.103,21	9,24%	0,95%	-10,12	3,81%	2,53%	3,81%
FI Caixa Brasil Im B 5 Tp RF LP	R\$ 524.472.731,59	5,01%	0,51%	-5,40	7,75%	1,82%	7,75%
Caixa FIC Brasil Gestão Estratégica RF	R\$ 794.651.183,95	5,93%	0,61%	-4,27	6,66%	1,32%	6,66%
Icatu Vang FI RF Inflação Cred Priv LP	R\$ 29.750.989,01	6,07%	0,62%	-6,53	7,60%	2,37%	7,60%
Icatu Vanguardia Inflação Curta FI RF LP	R\$ 78.849.311,66	5,22%	0,54%	-5,56	7,65%	1,81%	7,65%
Icatu Vang Inflação Longa FI RF LP	R\$ 94.808.812,56	19,82%	2,04%	-18,81	5,10%	7,50%	5,10%
Itau Inst Alocação Dinâmica RF FICFI	R\$ 64.400.324,94	1,66%	0,17%	-1,57	2,86%	0,20%	2,86%
Saia Im Inst Alocação Fc FI RF	R\$ 60.799.000,01	14,65%	1,51%	-13,28	7,60%	5,56%	7,60%
BB Prev RF Idca 2 FI	R\$ 317.176.278,77	4,19%	0,43%	-4,46	7,92%	1,53%	7,92%
TOTAL	R\$ 2.733.344.198,68						

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	TOTAL APLICADO	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	Máx Drawdown 12M	12M	dez20	2020
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Acoes Valor Fc FIA	R\$ 105.039.692,39	42,08%	4,29%	-44,79	5,98%	10,72%	5,98%
BB Mult Global Select Equity Ic FI	R\$ 44.046.955,17	27,77%	2,87%	-22,73	51,88%	1,09%	51,88%
BB Acoes Eq FIA - Bdr Nivel I	R\$ 70.397.488,98	29,04%	3,03%	-17,19	49,32%	0,68%	49,32%
Bradesco FIA Mid Smal Caps	R\$ 128.292.874,16	44,02%	4,44%	-1,08	-1,90%	8,61%	-1,90%
Bras Fc de FIA Institucional Ibr Alpha	R\$ 34.706.335,56	44,21%	4,48%	-46,69	4,62%	9,43%	4,62%
BTG Pactual Absoluta Inst FIC FIA	R\$ 315.688.693,03	45,96%	4,65%	-45,47	7,88%	5,23%	7,88%
BTG Pactual Economia Real FIP	R\$ 5.569.463,88						
Caixa FIA Consumo	R\$ 116.324.768,42	46,19%	4,66%	-1,01	-0,57%	4,89%	-0,57%
Icatu Vanguardia Acoes Ibr FI	R\$ 27.767.520,90	45,47%	4,61%	-47,90	4,02%	9,28%	4,02%
Icatu Vanguardia Dividendos FIA	R\$ 245.501.673,60	40,11%	4,08%	-1,59	-9,45%	7,96%	-9,45%
Itau Acoes Duráveis Fc	R\$ 172.274.057,48	44,11%	4,48%	-1,54	-4,87%	6,30%	-4,87%
Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	R\$ 10.665.485,89	44,49%	4,51%	-1,31	2,14%	8,37%	2,14%
Itau Institucional Acoes Phoenix Fc FI	R\$ 127.693.596,92	52,53%	5,29%	-1,53	-21,23%	7,97%	-21,23%
Itau Smal Cap Master FIA	R\$ 55.061.046,42	47,14%	4,74%	-0,62	-1,64%	7,74%	-1,64%
Santander Seleção Crescimento Senior Ações FICFI	R\$ 72.548.595,13	43,60%	4,41%	-2,20	-6,07%	7,61%	-6,07%
Santander FI Ibovespa Ativo Inst Acoes	R\$ 104.192.666,47	45,49%	4,60%	-2,26	-5,69%	7,43%	-5,69%
Santander Seleção Crescimento Ações FICFI	R\$ 48.825.960,46	43,56%	4,41%	-2,20	-6,12%	7,62%	-6,12%
Santander Global Equities Dólar Master Mult Ic FI	R\$ 61.275.973,24	23,66%	2,45%	-19,06	61,34%	0,48%	61,34%
Saia S P Real Ph FI Mult	R\$ 21.663.161,63	32,70%	3,36%	-34,78	12,58%	3,07%	12,58%
Saia Consumo Americano FIA Bdr Nivel I	R\$ 96.225.956,54	33,01%	3,41%	-22,47	44,45%	0,35%	44,45%
Az Quest Smal Mid Caps Inst Fc de FIA	R\$ 84.713.090,08	46,43%	4,66%	-0,59	-4,03%	6,93%	-4,03%
Occam Fc de FIA	R\$ 106.163.566,71	41,97%	4,27%	-44,74	7,87%	10,11%	7,87%
Sul America Equities FIA	R\$ 33.658.143,72	48,16%	4,85%	-1,07	-12,57%	7,70%	-12,57%
TOTAL	R\$ 2.088.296.766,80						

Quadro 1.

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

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

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

Nota 3: DRAWDOWN: Auxilia a determinar o risco de um investimento ao medir seu declínio desde o valor máximo alcançado pelo ativo, até o valor mínimo atingido em determinado período de tempo. Para determinar o percentual de queda, o Draw-Down é medido desde que a desvalorização começa até se atingir um novo ponto de máximo, garantindo, dessa forma, que a mínima da

série representa a maior queda ocorrida no período. Quanto mais negativo o número, maior a perda ocorrida e, consequentemente, maior o risco do ativo. Já um Draw-Down igual a zero, indica que não houve desvalorização do ativo ao longo do período avaliado.

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



Gráfico 1: Análise Risco x Retorno (12 M)

[Assinatura]

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

Nº	Fundos	Retorno	Volatilidade
1	BB Prev RF Irf M1 Tit Publ Fc	3,47	0,57
2	BB Prev RF Tit Publ VII FI	5,61	2,43
3	BB Prev RF Ima-B5+ Tp FI	5,06	19,66
4	BB Prev RF Idka 2 FI	7,92	4,19
5	BB Prev RF Alocação Ativa FcFI	5,09	6,25
6	BB Acoes Valor Fc FIA	5,98	42,08
7	Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	2,15	0,32
8	Bradesco FI RF Ref DI Premium	2,13	0,26
9	Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	7,86	5,37
10	Bradesco Fc FI RF Alocação Dinamica	4,66	6,90
11	Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	4,62	44,21
12	Bradesco FIA Mid Small Caps	-1,90	44,02
13	FI Caixa Brasil Irf M 1 Tp RF	3,63	0,55
14	FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	7,75	5,01
15	Caixa FI Brasil 2020 V Tp RF		
16	Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	3,81	9,24
17	Caixa FIC Brasil Gestão Estratégica RF	6,66	5,93
18	Caixa FIA Consumo	-0,57	46,19
19	Itau Instit Alocação Dinamica RF FICFI	2,86	1,66
20	Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	2,14	44,49
21	Itau Institucional Acoes Phoenix Fc FI	-21,23	52,53
22	Itau Acoes Dunamis Fc	-4,87	44,11
23	Small Cap Valuation Fc Acoes	-3,08	46,60
24	Santander Seleção Crescimento Ações FICFI	-6,12	43,56
25	Santander Seleção Crescimento Senior Ações I	-6,07	43,60
26	Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes	-5,69	45,49
27	Santander RF Ativo Fc FI	2,70	0,99
28	Icatu Vanguarda Dividendos FIA	-9,45	40,11
29	Icatu Vanguarda Inflação Curta FI RF LP	7,65	5,22
30	Icatu Vang Inflação Longa FI RF LP	5,10	19,82
31	Icatu Vanguarda Acoes Ibx FI	4,02	45,47
32	Safra Ima Institucional Fc FI RF	7,60	14,65
33	BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	7,88	45,96
34	Safra Consumo Americano FIA Bdr Nivel I	44,45	33,01
35	Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	-4,03	46,43
36	Occam Fc de FIA	7,87	41,97
37	Sul America Equities FIA	-12,57	48,16
38	Safra S P Reais Pb FI Mult	12,58	32,70
39	Icatu Vang FI RF Inflação Cred Priv LP	7,60	6,07
40	BB Mult Global Select Equity Ie FI	51,88	27,77
41	BTG Pactual Economia Real FIP		

Quadro 2. Legenda Gráfico 1.



2. VERIFICAÇÃO DE LASTRO DOS FUNDOS DE RISCO DE CRÉDITO

DATA BASE EM 31.12.20

TABELA - DURATION & YIELD POR CLASSE			
Ativo	Duration	Spread	% PL
DEB	3,41	2,10%	57,2%
CRI	0,00	0,00%	0,0%
LF	2,39	1,90%	9,2%
CDB	0,00	0,00%	0,0%
DPGE	0,00	0,00%	0,0%
NP	1,43	1,25%	1,2%
BONDO	0,00	0,00%	0,0%
FIDC	0,00	0,00%	0,0%
NTN-B	3,94	-	27,6%
Over	0,00	-	4,2%
Carteira Crédito	3,23	2,06%	68,2%
Crédito - Contribuição Fundo	0,96	1,41%	68,2%
Fundo (inclui DAP e NTN-B)	2,43	1,41%	100,0%

Quadro 03

TABELA - RATING EXTERNO*		
Rating	Financeiro	% PL
AAA	103 050 071	22,2%
AA+	90 733 303	11,0%
AA	136 699 972	16,6%
AA-	42 550 064	5,2%
A+	61 074 433	7,4%
DPGE	0	0,0%
A	0	0,0%
A-	13 129 249	1,6%
BBB+	0	0,0%
BBB	0	0,0%
BBB-	0	0,0%
BB+	0	0,0%
BB	0	0,0%
BB-	0	0,0%
B+	0	0,0%
B	0	0,0%
B-	9 491 007	1,1%
CCC	0	0,0%
CC	0	0,0%
C	0	0,0%
Sem Rating	26 082 743	3,2%
Tesouro / Over	262 900 810	31,8%
Total	825.720.536	100,0%

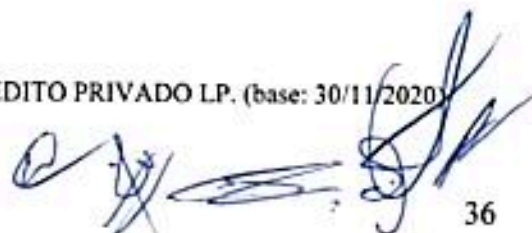
* Rating Externo é o menor rating atribuído entre o S&P, Moody's e Fitch.

Quadro 04.

TABELA - SETOR		
Setor	Financeiro	% PL
Elétrico	147 437 807	17,9%
Bancos	80 094 194	9,8%
Conc. Rodoviárias	79 421 455	9,6%
Serviço	67 746 757	8,2%
Saneamento	64 777 004	7,8%
Varejo	44 506 229	5,4%
Shopping Center	34 242 105	4,1%
Mineração e Siderurgia	11 521 269	1,4%
Logística	9 874 566	1,2%
Óleo e Gás	7 507 606	0,9%
Indústria e Comércio	5 242 844	0,6%
Papel e Celulose	4 043 431	0,5%
Holding	3 094 118	0,4%
Infraestrutura	2 510 351	0,3%
Tesouro / Over	262 900 810	31,8%
Total	825.720.536	100,0%

Quadro 05.

Nota: Dados referentes ao fundo ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CRÉDITO PRIVADO LP. (base: 30/11/2020)



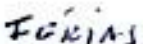
PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 15 de Janeiro de 2021, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de Dezembro/2020, com o acompanhamento da Rentabilidade e Risco das diversas modalidades de operações realizadas nas aplicações dos recursos do RPPS.

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

Todas as operações efetuadas, são acompanhadas pelo Controles Internos, e aprovadas pela Diretoria, com base nas Atas de Reunião do Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev.

Manaus – AM, 15 de janeiro de 2021.


Alan Nascimento
Coordenador

Bruno Costa Novo
Secretário


Bruno Barroso
Membro


Leonardo Cavalcanti
Membro


Andreza de Souza Silva
Membro


Claudinei Soares
Membro


André Luiz Bentes
Membro


Marcos Souza
Membro

APROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL - COFIS

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

☐ APROVAÇÃO

☐ REJEIÇÃO

Data:

Membros do Conselho Fiscal:

APROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL - CONAD

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

() APROVAÇÃO

() REJEIÇÃO

Data:

Membros do Conselho de Administração:

Processo: 2022.A.01477

Destino: DIRAF / PRESI

Assunto: **Relatório de Anual de Investimentos – 2021**

Data: 15/02/2022

RELATÓRIO Nº. 011/ 2022 – COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao exercício de **2021**, destacando:

- 1) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Poder Executivo, apresentando os saldos e **performance** dos Fundos de Investimentos, evolução dos saldos dos Fundos de Investimentos, imóveis e CVS, comparativo da rentabilidade com a Meta Atuarial, Evolução e variação dos recursos do FPREV Executivo (páginas 03 a 08);
- 2) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 09 a 10);
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (página 11);
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (página 12)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (página 13 a 14)
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (página 15 a 16)
- 7) Rentabilidade do Fundo Previdenciário - Consolidado – FPREV (página 17 a 18)
- 8) Disponibilidades do Fundo Financeiro – (páginas 19 a 20)
- 9) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 21)
- 10) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 22 a 27)
- 11) Total dos Recursos e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (página 28 a 29)
- 12) Relatório de Riscos da Carteira (página 30 a 38)
- 13) Parecer do Comitê de Investimentos (página 39).

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

002

1. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

1.1 SALDOS E PERFORMANCE RENDA FIXA

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 318.295.997,28	R\$ 271.047.525,22	(1,6263)	1,7339	0,9141	0,9942%	-0,3984%	-0,3984%	
BB PREVID TP VII	R\$ 7.079.089,17	R\$ 7.120.337,67	(0,4962)	1,7354	0,5826	1,8204%	6,5673%	6,5673%	
BB PREVID IDKA 2	R\$ 298.527.614,30	R\$ 300.635.822,30	(1,2527)	2,4291	0,7062	1,8603%	4,6456%	4,6456%	
BRADERCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 27.323.162,17	R\$ 27.544.534,01	0,5800	0,6400	0,8100	2,0436%	4,9400%	4,9400%	
BRADERCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 299.531,26	R\$ 75.287,33	0,4800	0,5700	0,6900	1,7500%	4,2045%	4,2045%	
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 53.088.094,00	R\$ 53.538.599,32	(1,4900)	2,7100	0,8500	2,0396%	2,7700%	2,7700%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 488.617.878,32	R\$ 492.367.703,98	(1,2440)	2,4678	0,7674	1,9697%	4,3127%	4,3127%	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 370.262.781,85	R\$ 373.319.988,18	(0,6612)	0,9059	0,8257	1,0664%	-0,1090%	-0,1090%	
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 28.840.676,76	R\$ 29.159.159,12	(2,4300)	3,1800	1,1000	1,7801%	4,8600%	4,8600%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 92.691.813,36	R\$ 93.399.609,36	(1,2400)	2,5000	0,7600	1,9983%	4,1400%	4,1400%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 112.807.769,26	R\$ 112.387.683,11	(3,8700)	4,4400	(0,3700)	0,0267%	-6,9600%	-6,9600%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 21.841,78	R\$ 22.029,78	(0,3600)	1,6400	0,8600	2,1451%	4,5300%	4,5300%	
SANTANDER CP CRESCIMENT INST	R\$ 99.044.974,59	R\$ 107.652.513,38	0,6774	0,5966	0,7678	2,0557%	2,2638%	NC	
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 25.973.110,33	R\$ 34.040.408,86	0,6100	0,6800	0,8400	2,1450%	6,2900%	6,2900%	
BTG PACTUAL CRED CORP FIC FI RF CP	R\$ 7.702.655,51	R\$ 34.855.852,12	-	0,6065	0,3388	0,9474%	0,9474%	NC	
ITAU HIGH GRADE RF DP FIC FI	R\$ 53.345.940,97	R\$ 61.624.409,75	0,6300	0,6400	0,8100	2,0944%	5,1600%	5,1600%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 131.098.727,06	R\$ 133.951.797,73	(3,2300)	3,2400	(0,1000)	-0,1946%	-4,8600%	-4,8600%	
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 2.115.021.657,97	R\$ 2.132.743.261,22							

Quadro 1.

1.2 SALDOS E PERFORMANCE RENDA VARIÁVEL

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 97.799.184,35	R\$ 101.786.211,51	(5,5414)	(0,8673)	4,0767	-2,5432%	-4,7614%	-4,7614%
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ -	R\$ 50.145.820,90	-	-	0,2900	0,2900%	0,2900%	NC
BRADERCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 147.266.685,61	R\$ 152.999.296,21	(12,5400)	(3,1700)	3,8900	-12,0181%	-9,8400%	-9,8400%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 229.424.304,27	R\$ 227.851.827,32	(13,0596)	(6,7100)	(0,6854)	-19,4492%	-31,7900%	-31,7900%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FI AÇÕES	R\$ 7.886.600,35	R\$ 7.941.806,13	(8,4938)	(4,3200)	0,7000	-11,8341%	-19,0262%	-19,0262%
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 13.877.804,75	R\$ 13.828.108,17	(0,2881)	(0,3007)	(0,3581)	-0,9439%	13,6198%	13,6198%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ -	R\$ 23.614.189,43	-	-	-	0,0000%	0,0000%	0,0000%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANT	R\$ 11.342.056,59	R\$ 11.997.742,88	(6,0249)	(0,5234)	5,7810	-1,1125%	-4,8165%	NC
ICATU VANGUARDIA DIVIDENDOS FIA	R\$ 76.046.531,25	R\$ 76.750.860,53	(6,9600)	(2,1900)	0,9300	-8,1513%	-18,2600%	-18,2600%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 156.101.613,81	R\$ 157.617.379,80	(7,5400)	(1,4400)	0,9700	-7,9875%	-8,5100%	-8,5100%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 33.466.421,25	R\$ 34.095.419,66	(8,7800)	(2,0600)	1,8800	-8,9795%	-16,6400%	-16,6400%
ITAU SMALL CAPS VALUATION	R\$ 100.650.594,60	R\$ 104.186.789,94	(11,0000)	(2,3200)	3,5100	-10,0134%	-10,0600%	-10,0600%
ITAÚ MM SP500 BRL FIC	R\$ 103.897.372,21	R\$ 109.658.401,60	7,6300	(0,5100)	5,5400	13,0134%	32,7400%	32,7400%
SANTANDER CRESC SENIOR (TOP AÇÕES)	R\$ 12.064,20	R\$ 12.327,77	(8,5268)	(4,1435)	2,1847	-10,4014%	-20,5854%	-20,5854%
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 27.147.276,78	R\$ 28.619.821,87	7,5500	(0,5100)	5,4200	12,8010%	32,1100%	32,1100%
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 74.798.444,07	R\$ 76.459.160,97	(6,7900)	(3,7900)	2,2200	-8,3318%	-9,7400%	-9,7400%
OCCAM FIC FIA	R\$ 78.132.767,17	R\$ 80.861.753,24	(4,9000)	(2,6700)	3,4900	-4,2088%	-12,7400%	-12,7400%
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 25.543.886,19	R\$ 26.804.565,85	(11,5680)	(5,6715)	4,9353	-12,4666%	-20,3621%	-20,3621%
BRASIL CAPITAL RP INSTIT FIC AÇÕES	R\$ 40.140.785,00	R\$ 41.113.518,85	(13,2500)	(3,7300)	2,4200	-14,4647%	-22,5000%	-22,5000%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 7.836.757,83	R\$ 8.130.314,94	(8,2413)	(2,7265)	3,7459	-7,3996%	-19,2064%	-19,2064%
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.309.964,96	R\$ 9.256.195,85	(0,5157)	(0,5050)	(0,5775)	-1,5898%	-2,7315%	NC
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 16.548.724,79	R\$ 17.242.753,11	(9,3469)	(3,3841)	4,1938	-8,7415%	-18,3646%	-18,3646%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 97.551.401,37	R\$ 97.670.543,70	(8,3800)	3,5100	0,1200	-5,0503%	-12,8200%	-12,8200%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 37.533.248,57	R\$ 38.807.964,00	(6,8300)	0,0600	3,4000	-3,6044%	-6,5000%	-6,5000%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 22.605.221,39	-	-	(0,7200)	-0,7200%	-1,8900%	-1,8900%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 34.255.367,85	R\$ 35.164.933,77	(8,1200)	(0,6400)	2,6600	-6,2797%	-11,4900%	-11,4900%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.426.569.857,82	R\$ 1.555.222.929,39						

Quadro 2.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

003

1.3 SALDOS E PERFORMANCE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 24.982.199,35	R\$ 25.980.390,21	6,7610	(0,7968)	3,9956	10,1421%	32,3477%	32,3477%	
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 152.880.147,40	R\$ 154.235.894,63	7,8592	(2,0098)	0,8868	6,6287%	23,3375%	23,3375%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 31.713.226,62	R\$ 32.233.514,06	7,5613	(2,3300)	1,6400	6,7780%	28,4800%	28,4800%	
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 163.204.312,77	R\$ 168.086.619,73	10,6509	(1,2881)	2,9915	12,4931%	33,4942%	33,4942%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 157.840.206,03	R\$ 163.286.774,60	8,5200	0,2100	3,4500	12,4997%	33,9200%	33,9200%	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 39.523.473,43	R\$ 41.389.565,28	7,3109	(0,7084)	4,7214	11,5814%	22,0687%	22,0687%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 39.539.540,73	R\$ 34.417.308,95	10,8973	0,1499	(12,9547)	-3,3244%	-0,5777%	-0,5777%	
TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	R\$ 609.683.106,33	R\$ 619.630.067,46							
TOTAL GERAL	R\$ 4.151.274.622,12	R\$ 4.307.596.258,07							

Quadro 3.

1.4 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 176.185.240,52	R\$ 178.402.400,81	1,7812	1,4796	1,2584	4,587%	17,1930%	17,1930%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 184.002.716,08	R\$ 186.335.713,27	1,7907	1,4891	1,2679	4,616%	17,3249%	17,3249%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 189.532.823,63	R\$ 191.980.923,04	1,8145	1,5129	1,2916	4,690%	17,6553%	17,6553%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 191.093.165,04	R\$ 193.516.093,32	1,7907	1,4891	1,2679	4,616%	17,3251%	17,3251%
TOTAL GERAL	R\$ 740.813.945,27	R\$ 750.235.130,45						

Quadro 4.

1.5 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	BRABESCO	BRABESCO	BRABESCO	BRABESCO
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\$ 178.402.400,81	R\$ 186.335.713,27	R\$ 191.980.923,04	R\$ 193.516.093,32
DATA DE EMISSÃO	15/01/2014	10/02/2010	10/02/2010	10/02/2010
DATA DA APLICAÇÃO	15/01/2014	15/01/2014	29/01/2014	15/01/2014
DATA DO RESGATE	15/05/2023	15/08/2030	15/08/2030	15/08/2040
TAXA DE JUROS CONTRATADA	6,48%	6,5998%	6,90%	6,60%

Quadro 5.

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

004

1.6 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	30/11/2021	31/12/2021
CVS - A	R\$ 1.065.466,26	R\$ 1.048.518,02
CVS - B	R\$ 6.893.246,70	R\$ 6.783.585,05
CVS - C	R\$ 138.214,44	R\$ 136.015,88
CVS - D	R\$ 755.936,28	R\$ 743.910,42
TOTAL	R\$ 8.852.863,68	R\$ 8.712.029,37

Quadro 6.

1.7 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/21	R\$ 30.247,09	R\$ 145.084,72	R\$ 175.331,81
fev/21	R\$ 29.827,12	R\$ 145.084,72	R\$ 174.911,84
mar/21	R\$ 29.407,16	R\$ 145.084,72	R\$ 174.491,88
abr/21	R\$ 28.978,18	R\$ 145.084,72	R\$ 174.062,90
mai/21	R\$ 28.567,21	R\$ 145.084,72	R\$ 173.651,93
jun/21	R\$ 28.147,25	R\$ 145.084,72	R\$ 173.231,97
jul/21	R\$ 27.727,27	R\$ 145.084,72	R\$ 172.811,99
ago/21	R\$ 27.307,30	R\$ 145.084,72	R\$ 172.392,02
set/21	R\$ 26.887,32	R\$ 145.084,32	R\$ 171.971,64
out/21	R\$ 26.887,32	R\$ 145.084,32	R\$ 171.971,64
nov/21	R\$ 26.047,38	R\$ 145.084,72	R\$ 171.132,10
dez/21	R\$ 25.639,76	R\$ 145.100,57	R\$ 170.740,33
TOTAL	R\$ 335.670,36	R\$ 1.741.031,69	R\$ 2.076.702,05

Quadro 7.

1.8 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2021 (Contrato Regular)			
MÊS	UEA	SEAS	TOTAL
jan/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -
fev/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -
mar/21	R\$ -	R\$ 100.364,40	R\$ 100.364,40
abr/21	R\$ 87.271,44	R\$ 100.364,40	R\$ 187.635,84
mai/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -
jun/21	R\$ -	R\$ 301.093,20	R\$ 301.093,20
jul/21	R\$ 43.635,72	R\$ -	R\$ 43.635,72
ago/21	R\$ -	R\$ 100.364,40	R\$ 100.364,40
set/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -
out/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -
nov/21	R\$ -	R\$ 100.364,40	R\$ 100.364,40
dez/21	R\$ 218.178,60	R\$ 200.728,80	R\$ 418.907,40
TOTAL	R\$ 349.085,76	R\$ 903.279,60	R\$ 1.252.365,36

Quadro 8.

1.9 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	30/11/2021	31/12/2021	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.151.274.622,12	R\$ 4.307.596.258,07	83,8868%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 740.813.945,27	R\$ 750.235.130,45	14,6102%
TÍTULOS CVS	R\$ 8.852.863,68	R\$ 8.712.029,37	0,1697%
IMÓVEIS	R\$ 61.835.325,18	R\$ 68.293.435,00	1,3300%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 16.176.311,25	R\$ 173.785,24	0,0034%
TOTAL	R\$ 4.978.953.067,50	R\$ 5.135.010.638,13	100,00%

Quadro 9.

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

005

1.10 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
dez/20	R\$ 4.808.000.009,11	2,28%	-7,07%	-7,07%
jan/21	R\$ 4.691.638.612,35	-2,42%	-2,42%	-8,75%
fev/21	R\$ 4.654.824.437,71	-0,78%	-3,19%	-9,45%
mar/21	R\$ 4.764.067.642,49	2,35%	-0,91%	1,67%
abr/21	R\$ 4.868.735.602,27	2,20%	1,26%	2,42%
mai/21	R\$ 4.985.703.862,07	2,40%	3,70%	3,69%
jun/21	R\$ 5.049.248.442,12	1,27%	5,02%	4,38%
jul/21	R\$ 5.055.266.764,76	0,12%	5,14%	3,12%
ago/21	R\$ 5.028.755.971,61	-0,52%	4,59%	4,82%
set/21	R\$ 4.986.467.576,78	-0,84%	3,71%	7,20%
out/21	R\$ 4.928.789.222,04	-1,16%	2,51%	8,34%
nov/21	R\$ 4.978.953.067,50	1,02%	3,56%	5,92%
dez/21	R\$ 5.135.010.638,13	3,13%	6,80%	6,80%

Quadro 10.

1.11 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

1. Investimentos - Executivo

Saldo dos Investimentos em 12/2020		R\$ 4.808.000.009,11	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2021	R\$ 584.279,15	R\$ 82.104.432,44	R\$ -81.520.153,29
02/2021	R\$ 40.864.605,59	R\$ 44.974.382,51	R\$ -4.109.776,92
03/2021	R\$ 41.485.170,47	R\$ 10.665.619,53	R\$ 30.819.550,94
04/2021	R\$ 41.308.639,76	R\$ 10.074.221,86	R\$ 31.234.417,90
05/2021	R\$ 41.318.216,48	R\$ 14.353.928,89	R\$ 26.964.287,59
06/2021	R\$ 50.044.250,01	R\$ 10.611.950,64	R\$ 39.432.299,37
07/2021	R\$ 47.181.791,70	R\$ 9.896.860,10	R\$ 37.284.931,60
08/2021	R\$ 26.480.105,00	R\$ 11.394.062,81	R\$ 15.086.042,19
09/2021	R\$ 41.572.477,52	R\$ 10.674.589,38	R\$ 30.897.888,14
10/2021	R\$ 43.880.558,88	R\$ 10.627.718,85	R\$ 33.252.840,03
11/2021	R\$ 54.114.701,48	R\$ 14.772.501,88	R\$ 39.342.199,60
12/2021	R\$ 94.087.378,25	R\$ 11.974.925,91	R\$ 82.112.452,34
Saldo dos Investimentos em 12/2021		R\$ 5.135.010.638,13	

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

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	10,0611 %	10,0611 %	0,7300 %
Juros	5,4500 %	5,4500 %	0,4432 %
Meta	16,0594 %	16,0594 %	1,1764 %
Rentabilidade em %	0,9536 %	0,9536 %	1,4852 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 46.213.649,53	R\$ 46.213.649,53	R\$ 73.945.118,29
Resultado em %	-13,0155 %	-13,0155 %	+0,3051 %
Resultado em R\$	R\$ -731.506.030,76	R\$ -731.506.030,76	R\$ +15.370.857,46

Quadro 11.

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldossegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT13NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

006

2. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO- FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 5.138.980,88	R\$ 5.181.412,73	(0,6612)	0,9059	0,8257	1,0664%	-0,1090%	-0,1090%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 90.312,37	R\$ 91.089,75	(0,3600)	1,6400	0,8600	2,1451%	4,5300%	4,5300%
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 2.014.068,02	R\$ 2.036.309,03	(2,4300)	3,1800	1,1000	1,7801%	4,8600%	4,8600%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FI RF LP	R\$ 75.779,65	R\$ 75.497,45	(3,8700)	4,4400	(0,3700)	0,0267%	-6,9600%	-6,9600%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 75.668,32	R\$ 75.590,14	(3,2300)	3,2400	(0,1000)	-0,1946%	-4,8600%	-4,8600%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 362.174,91	R\$ 364.732,60	(1,2527)	2,4291	0,7062	1,8603%	4,6456%	4,6456%
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ -	R\$ 165.527,34	-	-	0,3388	0,3388%	0,3388%	NC
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 7.756.984,15	R\$ 7.990.159,04						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 437.786,25	R\$ 441.840,95	(6,9600)	(2,1900)	0,9300	-8,1513%	-18,2600%	-18,2600%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 1.105.241,25	R\$ 1.097.665,91	(13,0596)	(6,7100)	(0,6854)	-19,4492%	-31,7869%	-31,7869%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT	R\$ 452.491,70	R\$ 478.650,33	(6,0249)	(0,5234)	5,7810	-1,1125%	-4,8165%	NC
OCCAM FIC FIA	R\$ 1.806.814,71	R\$ 1.869.922,31	(4,9000)	(2,6700)	3,4900	-4,2088%	-12,7400%	-12,7400%
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 107.239,32	R\$ 109.838,06	(13,2500)	(3,7300)	2,4200	-14,4647%	-22,5000%	-22,5000%
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 745.988,32	R\$ 786.452,84	7,5500	(0,5100)	5,4200	12,8010%	32,1100%	32,1100%
ITAÚ MM SP500 BRL FIC	R\$ 161.568,48	R\$ 170.527,33	7,6300	(0,5100)	5,5400	13,0134%	32,7400%	32,7400%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 4.817.130,03	R\$ 4.954.897,73						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 1.642.623,01	R\$ 1.699.304,75	8,5200	0,2100	3,4500	12,4997%	33,9200%	33,9200%
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.642.623,01	R\$ 1.699.304,75						

TOTAL GERAL	R\$ 14.216.737,19	R\$ 14.644.361,52						
-------------	-------------------	-------------------	--	--	--	--	--	--

Quadro 12.

2.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.520.893,95	R\$ 2.554.337,82	1,8145	1,5129	1,2916	4,6899%	17,6552%	17,6552%
TOTAL GERAL	R\$ 2.520.893,95	R\$ 2.554.337,82						

Quadro 13.

2.3 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	30/11/2021	31/12/2021
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 7.756.984,15	R\$ 7.990.159,04
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 4.817.130,03	R\$ 4.954.897,73
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.642.623,01	R\$ 1.699.304,75
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.520.893,95	R\$ 2.554.337,82
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 16.555.960,29	R\$ 17.198.699,34

Quadro 14.

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT3NDU4



2.4 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

1. Investimentos - Assembléia

Saldo dos Investimentos em 12/2020		R\$ 15.166.901,59	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2021	R\$ 286.790,86	R\$ 0,00	R\$ 286.790,86
02/2021	R\$ 143.097,24	R\$ 0,00	R\$ 143.097,24
03/2021	R\$ 143.973,76	R\$ 0,00	R\$ 143.973,76
04/2021	R\$ 144.001,52	R\$ 0,00	R\$ 144.001,52
05/2021	R\$ 144.070,46	R\$ 0,00	R\$ 144.070,46
06/2021	R\$ 144.136,78	R\$ 0,00	R\$ 144.136,78
07/2021	R\$ 174.168,74	R\$ 0,00	R\$ 174.168,74
08/2021	R\$ 152.615,42	R\$ 0,00	R\$ 152.615,42
09/2021	R\$ 152.252,38	R\$ 0,00	R\$ 152.252,38
10/2021	R\$ 165.653,56	R\$ 0,00	R\$ 165.653,56
11/2021	R\$ 169.762,40	R\$ 0,00	R\$ 169.762,40
12/2021	R\$ 164.966,52	R\$ 0,00	R\$ 164.966,52
Saldo dos Investimentos em 12/2021		R\$ 17.198.699,34	

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

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	10,0611 %	10,0611 %	0,7300 %
Juros	5,4500 %	5,4500 %	0,4432 %
Meta	16,0594 %	16,0594 %	1,1764 %
Rentabilidade em %	0,2874 %	0,2874 %	1,7691 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 46.308,11	R\$ 46.308,11	R\$ 296.101,68
Resultado em %	-13,5896 %	-13,5896 %	+0,5857 %
Resultado em R\$	R\$ -2.537.504,90	R\$ -2.537.504,90	R\$ +99.193,94

Quadro 15.

3. RECURSOS DO MPE – FPREV

3.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 7.616.402,95	R\$ 7.679.290,50	(0,6612)	0,9059	(0,8257)	-0,5890%	-0,1090%	-0,1090%	
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 40.225.944,68	R\$ 40.540.838,53	(0,7200)	1,4500	0,7800	1,5052%	-0,1600%	-0,1600%	
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 77.983.961,20	R\$ 78.696.812,90	(1,6263)	1,7339	0,9141	0,9942%	-0,3984%	-0,3984%	
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 3.266.091,36	R\$ 3.289.156,56	(1,2527)	2,4291	0,7062	1,8603%	4,6456%	4,6456%	
BRANCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 1.651.313,10	R\$ 1.664.692,02	0,5800	0,6400	0,8100	2,0436%	4,9400%	4,9400%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FIA RF	R\$ 1.627.815,14	R\$ 1.626.133,37	(3,2300)	3,2400	(0,1000)	-0,1946%	-4,8600%	-4,8600%	
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 132.371.528,43	R\$ 133.496.923,88							

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRANCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 22.638.699,25	R\$ 23.288.292,57	(7,7600)	(3,5900)	2,8700	-8,5192%	-15,2800%	-15,2800%	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.265.459,96	R\$ 1.296.125,92	(13,2500)	(3,7300)	2,4200	-14,4647%	-22,5000%	-22,5000%	
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 7.154.927,20	R\$ 7.543.030,69	7,5500	(0,5100)	5,4200	12,8010%	32,1100%	32,1100%	
BB AÇÕES VALOR	R\$ 20.179.779,54	R\$ 21.002.458,48	(5,5414)	(0,8673)	4,0767	-2,5432%	-4,7614%	-4,7614%	
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 51.238.865,95	R\$ 53.129.907,66							

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 8.151,70	R\$ 3.913.565,18
TOTAL RECURSOS	R\$ 183.618.546,08	R\$ 190.540.396,72

Quadro 16.



Relatório de Anual Investimentos - 2021

008

3.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

1. Investimentos - Ministério Público

Saldo dos Investimentos em 12/2020		R\$ 169.242.211,10	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2021	R\$ 3.008.450,20	R\$ 8.065,16	R\$ 3.000.385,04
02/2021	R\$ 1.585.217,06	R\$ 1.642,15	R\$ 1.583.574,91
03/2021	R\$ 1.564.682,30	R\$ 17.772,47	R\$ 1.546.909,83
04/2021	R\$ 1.594.346,58	R\$ 9.707,31	R\$ 1.584.639,27
05/2021	R\$ 1.573.220,64	R\$ 41.257,15	R\$ 1.531.963,49
06/2021	R\$ 1.959.057,05	R\$ 12.521,07	R\$ 1.946.535,98
07/2021	R\$ 2.023.578,91	R\$ 55.617,86	R\$ 1.967.961,05
08/2021	R\$ 1.638.039,45	R\$ 23.802,84	R\$ 1.614.236,61
09/2021	R\$ 1.647.557,59	R\$ 3.779,70	R\$ 1.643.777,89
10/2021	R\$ 1.646.387,89	R\$ 23.802,84	R\$ 1.622.585,05
11/2021	R\$ 3.285.936,72	R\$ 81.114,00	R\$ 3.204.822,72
12/2021	R\$ 3.913.495,83	R\$ 32.084,33	R\$ 3.881.411,50
Saldo dos Investimentos em 12/2021		R\$ 190.540.396,72	

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

Taxa de Juros Anual	5,4500 %		Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês	
IPCA	10,0611 %	10,0611 %	0,7300 %	
Juros	5,4500 %	5,4500 %	0,4432 %	
Meta	16,0594 %	16,0594 %	1,1764 %	
Rentabilidade em %	-2,1312 %	-2,1312 %	1,6558 %	
Rentabilidade em R\$	R\$ -3.830.617,72	R\$ -3.830.617,72	R\$ 3.040.439,14	
Resultado em %	-15,6735 %	-15,6735 %	+0,4738 %	
Resultado em R\$	R\$ -32.647.074,45	R\$ -32.647.074,45	R\$ +880.282,08	

Quadro 17.

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT3NDU4



4. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGIA	R\$ 7.773.369,25	R\$ 7.837.552,85	(0,6612)	0,9059	0,8257	1,0664%	-0,1090%	-0,1090%
BRANCO INST. ALOC. DINAMICA	R\$ 8.574.531,11	R\$ 8.641.653,63	(0,7200)	1,4500	0,7800	1,5052%	-0,1600%	-0,1600%
BRANCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 9.496.445,81	R\$ 9.569.604,29	(1,2800)	2,4700	0,7700	1,9373%	3,6700%	3,6700%
BRANCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 1.165.427,15	R\$ 1.174.869,42	0,5800	0,6400	0,8100	2,0436%	4,9400%	4,9400%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 1.148.861,72	R\$ 1.147.674,78	(3,2300)	3,2400	(0,1000)	-0,1946%	-4,8600%	-4,8600%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 2.079.189,88	R\$ 2.093.873,16	(1,2527)	2,4291	0,7062	1,8603%	4,6456%	4,6456%
TOTAL	R\$ 30.237.824,92	R\$ 30.465.228,13						

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 850.905,58	R\$ 871.525,63	(13,2500)	(3,7300)	2,4200	-14,4647%	-22,5000%	-22,5000%
BRANCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	R\$ 823.044,75	R\$ 846.661,14	(7,7600)	(3,5900)	2,8700	-8,5192%	-15,2800%	-15,2800%
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 3.568.351,97	R\$ 3.761.909,47	7,5500	(0,5100)	5,4200	12,8010%	32,1100%	32,1100%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 13.934,67	R\$ 14.740,24	(6,0249)	(0,5234)	5,7810	-1,1125%	-4,8165%	NC
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 1.734.677,1400	-	-	(0,7200)	-0,7200%	-1,8900%	-1,8900%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ -	R\$ 1.734.806,6870	-	-	-	0,0000%	0,0000%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 5.256.236,97	R\$ 8.964.320,31						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 2.726,09	R\$ -
TOTAL RECURSOS	R\$ 35.496.787,98	R\$ 39.429.548,44

Quadro 18.

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV

1. Investimentos - Defensoria

Saldo dos Investimentos em 12/2020			R\$ 25.328.013,69
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2021	R\$ 6.283,41	R\$ 77.294,71	R\$ -71.011,30
02/2021	R\$ 1.003.038,47	R\$ 51.465,27	R\$ 951.573,20
03/2021	R\$ 992.747,96	R\$ 51.465,27	R\$ 941.282,69
04/2021	R\$ 999.548,81	R\$ 39.463,54	R\$ 960.085,27
05/2021	R\$ 1.057.911,85	R\$ 96.855,31	R\$ 961.056,54
06/2021	R\$ 1.062.228,59	R\$ 51.465,27	R\$ 1.010.763,32
07/2021	R\$ 1.085.187,70	R\$ 51.462,70	R\$ 1.033.725,43
08/2021	R\$ 1.172.401,85	R\$ 51.465,27	R\$ 1.120.936,58
09/2021	R\$ 1.179.063,91	R\$ 12.001,73	R\$ 1.167.062,18
10/2021	R\$ 1.172.130,12	R\$ 51.465,27	R\$ 1.120.664,85
11/2021	R\$ 1.220.800,58	R\$ 90.180,34	R\$ 1.130.620,24
12/2021	R\$ 3.547.742,31	R\$ 80.855,04	R\$ 3.466.887,27
Saldo dos Investimentos em 12/2021			R\$ 39.429.548,44

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

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	10,0611 %	10,0611 %	0,7300 %
Juros	5,4500 %	5,4500 %	0,4432 %
Meta	16,0594 %	16,0594 %	1,1764 %
Rentabilidade em %	1,0320 %	1,0320 %	1,3124 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 307.888,48	R\$ 307.888,48	R\$ 465.873,19
Resultado em %	-12,9480 %	-12,9480 %	+0,1344 %
Resultado em R\$	R\$ -4.461.600,01	R\$ -4.461.600,01	R\$ +48.275,74

Quadro 19.



Relatório de Anual Investimentos - 2021

010

5. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 162.612.742,86	R\$ 163.955.412,81	(0,6612)	0,9059	0,8257	1,0664%	-0,1090%	-0,1090%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 51.129.669,27	R\$ 51.597.045,77	(1,6263)	1,7339	0,9141	0,9942%	-0,3984%	-0,3984%
BB PREV RF IDKA 2	R\$ 170.104.422,44	R\$ 171.305.703,28	(1,2527)	2,4291	0,7062	1,8603%	4,6456%	4,6456%
BRASECO FI RF DI PREMIUM	R\$ 1.559.379,57	R\$ 1.572.013,64	0,5800	0,6400	0,8100	2,0436%	4,9400%	4,9400%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 1.849.896,21	R\$ 1.847.985,00	(3,2300)	3,2400	(0,1000)	-0,1946%	-4,8600%	-4,8600%
BRASECO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 41.401.091,30	R\$ 41.360.457,88	(1,2800)	2,4700	0,7700	1,9373%	3,6700%	3,6700%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 428.657.201,65	R\$ 431.638.618,38						
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 2.762.118,40	R\$ 2.829.052,97	(13,2500)	(3,7300)	2,4200	-14,4647%	-22,5000%	-22,5000%
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 19.035.900,76	R\$ 20.068.461,87	7,5500	(0,5100)	5,4200	12,8010%	32,1100%	32,1100%
BRASECO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 4.039.107,04	R\$ 4.155.004,91	(7,7600)	(3,5900)	2,8700	-8,5192%	-15,2800%	-15,2800%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 8.778.681,23	R\$ 9.286.178,35	(6,0249)	(0,5234)	5,7810	-1,1125%	-4,8165%	NC
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 2.959.907,11	-	-	(0,7200)	-0,7200%	-0,7200%	NC
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ -	R\$ 2.960.078,94	-	-	-	0,0000%	-3,7457%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 34.615.807,43	R\$ 42.258.684,15						
FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 30.436.642,75	R\$ 31.652.771,81	6,7610	(0,7968)	3,9956	10,1421%	32,3477%	32,3477%
TOTAL - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 30.436.642,75	R\$ 31.652.771,81						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 33.268,74	R\$ 1.268.056,82						
TOTAL	R\$ 493.742.920,57	R\$ 506.818.131,16						

Quadro 20.

5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Justiça

Saldo dos Investimentos em 12/2020			R\$ 451.531.332,20
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2021	R\$ 3.459.800,94	R\$ 280.567,30	R\$ 3.179.233,64
02/2021	R\$ 3.471.253,44	R\$ 284.979,37	R\$ 3.186.274,07
03/2021	R\$ 3.427.904,40	R\$ 367.719,45	R\$ 3.060.184,95
04/2021	R\$ 3.574.036,92	R\$ 317.977,95	R\$ 3.256.058,97
05/2021	R\$ 3.591.371,99	R\$ 308.689,08	R\$ 3.282.682,91
06/2021	R\$ 3.620.988,47	R\$ 346.178,51	R\$ 3.274.809,96
07/2021	R\$ 3.670.676,51	R\$ 315.553,25	R\$ 3.355.123,26
08/2021	R\$ 3.690.680,27	R\$ 318.681,54	R\$ 3.371.998,73
09/2021	R\$ 3.738.023,51	R\$ 317.532,32	R\$ 3.420.491,19
10/2021	R\$ 3.756.511,37	R\$ 317.532,32	R\$ 3.438.979,05
11/2021	R\$ 3.805.215,10	R\$ 331.580,86	R\$ 3.473.634,24
12/2021	R\$ 7.253.729,28	R\$ 456.014,72	R\$ 6.797.714,56
Saldo dos Investimentos em 12/2021			R\$ 506.818.131,16

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

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	10,0611 %	10,0611 %	0,7300 %
Juros	5,4500 %	5,4500 %	0,4432 %
Meta	16,0594 %	16,0594 %	1,1764 %
Rentabilidade em %	2,5975 %	2,5975 %	1,2714 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 12.189.613,43	R\$ 12.189.613,43	R\$ 6.277.496,03
Resultado em %	-11,5991 %	-11,5991 %	+0,0939 %
Resultado em R\$	R\$ -63.108.243,18	R\$ -63.108.243,18	R\$ +468.920,17

Quadro 21.

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

011

6. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 41.674.722,09	R\$ 42.018.824,25	(0,6612)	0,9059	0,8257	1,0664%	-0,1090%	-0,1090%	
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 31.815.161,61	R\$ 32.039.840,92	(1,2527)	2,4291	0,7062	1,8603%	4,6456%	4,6456%	
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 21.229.616,44	R\$ 21.423.676,45	(1,6263)	1,7339	0,9141	0,9942%	-0,3984%	-0,3984%	
BRAPRESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 301.989,72	R\$ 304.436,43	0,5800	0,6400	0,8100	2,0436%	4,9400%	4,9400%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 298.055,53	R\$ 297.747,60	(3,2300)	3,2400	(0,1000)	-0,1946%	-4,8600%	-4,8600%	
BRAPRESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 7.619.299,10	R\$ 7.677.996,48	(1,2800)	2,4700	0,7700	1,9373%	3,6700%	3,6700%	
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 102.938.844,49	R\$ 103.762.522,13							
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 746.220,00	R\$ 764.303,19	(13,2500)	(3,7300)	2,4200	-14,4647%	-22,5000%	-22,5000%	
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 3.551.602,97	R\$ 3.744.251,95	7,5500	(0,5100)	5,4200	12,8010%	32,1100%	32,1100%	
BRAPRESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 429.565,78	R\$ 441.891,72	(7,7600)	(3,5900)	2,8700	-8,5192%	-15,2800%	-15,2800%	
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT.	R\$ 8.778.681,23	R\$ 9.286.178,35	(6,0249)	(0,5234)	5,7810	-1,1125%	-4,8165%	NC	
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 859.592,91	-	-	(1,8900)	-1,8900%	-1,8900%	-1,8900%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ -	R\$ 859.642,80	-	-	-	0,0000%	1,8900%	0,0000%	
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 13.506.069,98	R\$ 15.955.860,92							
FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 582.119,38	R\$ 605.378,59	6,7610	(0,7968)	3,9956	10,1421%	32,3477%	32,3477%	
TOTAL - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 582.119,38	R\$ 605.378,59							
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 50.000,00	R\$ -							
TOTAL	R\$ 117.077.033,85	R\$ 120.323.761,64							

Quadro 22.

6.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Contas

Saldo dos Investimentos em 12/2020			R\$ 111.881.662,84
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2021	R\$ 7.943,52	R\$ 0,00	R\$ 7.943,52
02/2021	R\$ 1.040.178,80	R\$ 0,00	R\$ 1.040.178,80
03/2021	R\$ 523.658,87	R\$ 0,00	R\$ 523.658,87
04/2021	R\$ 4.964,70	R\$ 0,00	R\$ 4.964,70
05/2021	R\$ 1.036.389,86	R\$ 67.687,34	R\$ 968.702,52
06/2021	R\$ 521.558,25	R\$ 32.206,97	R\$ 489.351,28
07/2021	R\$ 523.292,11	R\$ 39.670,93	R\$ 483.621,18
08/2021	R\$ 587.761,57	R\$ 32.116,97	R\$ 555.644,60
09/2021	R\$ 596.685,79	R\$ 32.206,97	R\$ 564.478,82
10/2021	R\$ 621.603,17	R\$ 7.463,96	R\$ 614.139,21
11/2021	R\$ 1.288.278,50	R\$ 56.027,71	R\$ 1.232.250,79
12/2021	R\$ 1.716.449,08	R\$ 39.670,93	R\$ 1.676.778,15
Saldo dos Investimentos em 12/2021			R\$ 120.323.761,64

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

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	10,0611 %	10,0611 %	0,7300 %
Juros	5,4500 %	5,4500 %	0,4432 %
Meta	16,0594 %	16,0594 %	1,1764 %
Rentabilidade em %	0,2445 %	0,2445 %	1,3410 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 280.386,36	R\$ 280.386,36	R\$ 1.569.949,64
Resultado em %	-13,6266 %	-13,6266 %	+0,1626 %
Resultado em R\$	R\$ -18.125.363,47	R\$ -18.125.363,47	R\$ +192.611,75

Quadro 23.

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT13NDU4



7. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV

1. Investimentos - CONSOLIDADO

Saldo dos Investimentos em 12/2020		R\$ 5.581.150.130,53	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2021	R\$ 7.353.548,08	R\$ 82.470.359,61	R\$ -75.116.811,53
02/2021	R\$ 48.107.390,60	R\$ 45.312.469,30	R\$ 2.794.921,30
03/2021	R\$ 48.138.137,76	R\$ 11.102.576,72	R\$ 37.035.561,04
04/2021	R\$ 47.625.538,29	R\$ 10.441.370,66	R\$ 37.184.167,63
05/2021	R\$ 48.721.181,28	R\$ 14.868.417,77	R\$ 33.852.763,51
06/2021	R\$ 57.352.219,15	R\$ 11.054.322,46	R\$ 46.297.896,69
07/2021	R\$ 54.658.695,67	R\$ 10.359.164,41	R\$ 44.299.531,26
08/2021	R\$ 33.721.603,56	R\$ 11.820.129,43	R\$ 21.901.474,13
09/2021	R\$ 48.886.060,70	R\$ 11.040.110,10	R\$ 37.845.950,60
10/2021	R\$ 51.242.844,99	R\$ 11.027.983,24	R\$ 40.214.861,75
11/2021	R\$ 63.884.694,78	R\$ 15.331.404,79	R\$ 48.553.289,99
12/2021	R\$ 110.683.761,27	R\$ 12.583.550,93	R\$ 98.100.210,34
Saldo dos Investimentos em 12/2021		R\$ 6.009.321.175,43	

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

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	10,0611 %	10,0611 %	0,7300 %
Juros	5,4500 %	5,4500 %	0,4432 %
Meta	16,0594 %	16,0594 %	1,1764 %
Rentabilidade em %	0,9761 %	0,9761 %	1,4693 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 55.207.228,19	R\$ 55.207.228,19	R\$ 85.594.977,97
Resultado em %	-12,9962 %	-12,9962 %	+0,2894 %
Resultado em R\$	R\$ -852.385.816,77	R\$ -852.385.816,77	R\$ +17.060.141,14

Quadro 24.

Nota 1: Os valores de **Receita** referem-se às contribuições previdenciárias recebidas no período. Os valores de **Despesas** referem-se ao pagamento de inativos e pensionistas.

Nota 2: Foram revisados os valores de **Receitas** e **Despesas**, com base nos Controles da GERA/COFIN, para o exercício de 2021.

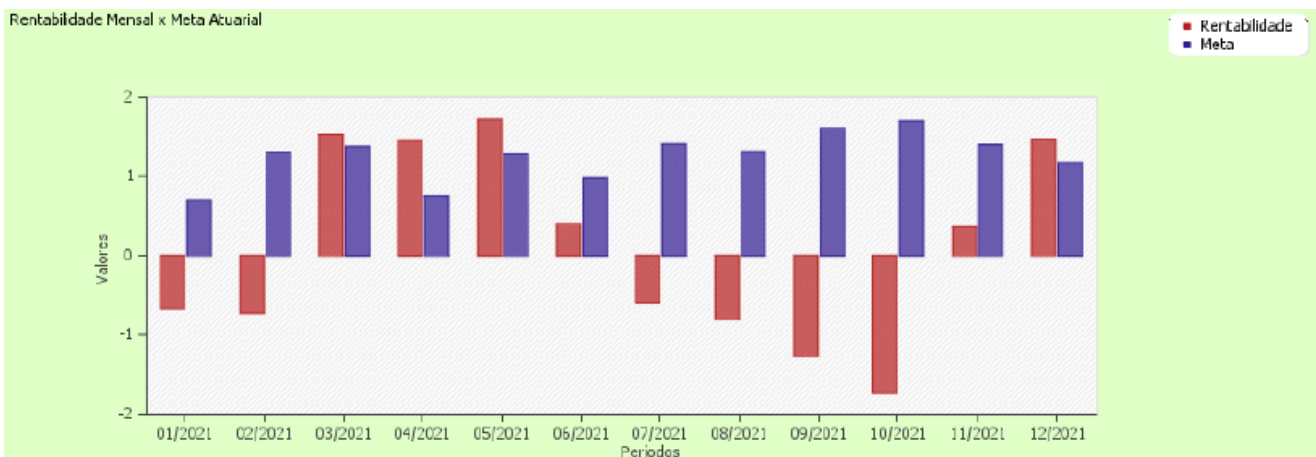


Gráfico 1.



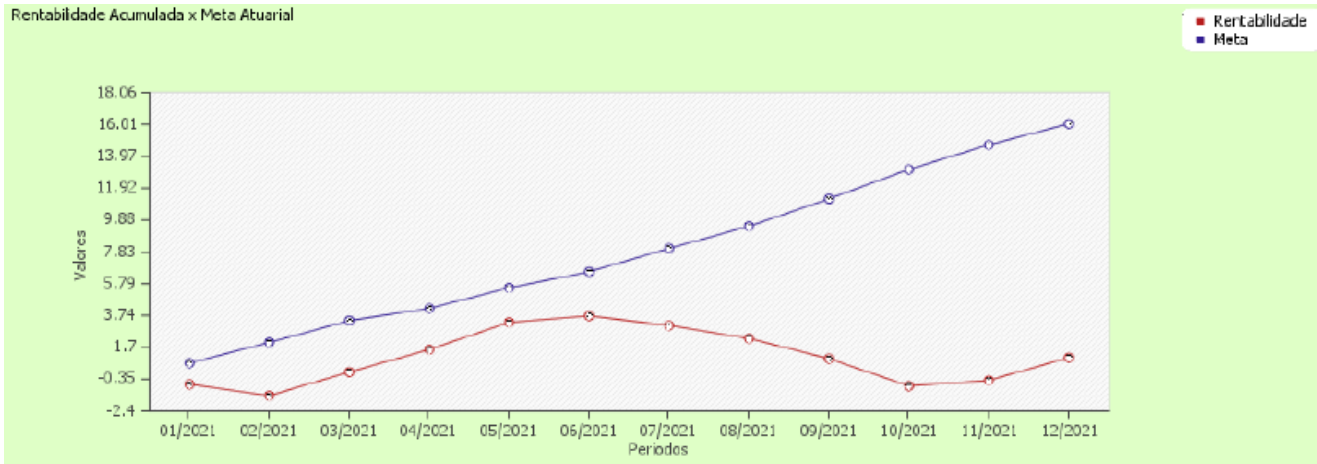


Gráfico 2.

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT3NDU4



8. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

8.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 11.753.073,29	R\$ 20.700.266,91
FUNDO BRADESCO RF - COMPREV	R\$ 6.054.723,75	R\$ 6.259.794,93
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 0,02	R\$ 0,02
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 27.382.766,13	R\$ 3.320.989,92
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 264.295,10	R\$ 264.295,10
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 23.432.002,70
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - COMPREV	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 45.454.859,29	R\$ 53.977.349,58

Quadro 25.

8.2 FPPM – Fundo de Proteção Previdenciária dos Militares

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R\$ 4.723,53	R\$ 24.930.709,80
BRADESCO DI PREMIUM - FPPM	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R\$ 1,00	R\$ 453,96
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ 24.806,63	R\$ 24.806,63
TOTAL	R\$ 29.531,16	R\$ 24.955.970,39

Quadro 26.

8.3 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ 803.859,92
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ -	R\$ 803.859,92

Quadro 27.

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT3NDU4



8.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 449.391,24	R\$ 451.032,00
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 58.132,69	R\$ 2.075,62
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 179,35	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 507.703,28	R\$ 453.108,62

Quadro 28.

8.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 985.698,89	R\$ 3.172.933,30
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ 420.215,41	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 6.066.281,79
TOTAL	R\$ 1.405.914,30	R\$ 9.239.215,09

Quadro 29.

8.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 6.376.088,17	R\$ 12.279.664,11
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	R\$ 602.764,51	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 547.786,19
TOTAL	R\$ 6.978.853,68	R\$ 12.827.450,30

Quadro 30.

8.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.808.646,58	R\$ 6.709.308,76
DISPONIBILIDADE COBERTURA TCE FFIN	R\$ 1.946.837,55	R\$ 705,87
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 28.167,48	R\$ -
TOTAL	R\$ 4.783.651,61	R\$ 6.710.014,63

TOTAL GERAL FFIN	R\$ 59.160.513,32	R\$ 108.966.968,53
-------------------------	--------------------------	---------------------------

Quadro 31.



9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

9.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 5.448.371,83	R\$ 1.143,62
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 45.106.086,68	R\$ 40.560.407,77
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 50.554.459,51	R\$ 40.561.552,39

Quadro 32.

9.2 Taxa de Administração - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 35.718,27
TOTAL	R\$ -	R\$ 35.718,27

Quadro 33.

9.3 Taxa de Administração - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 56.848,80	R\$ 61.970,46
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 56.848,80	R\$ 61.971,46

Quadro 34.

9.4 Taxa de Administração – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ 605.835,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 196.993,79	R\$ -
TOTAL	R\$ 196.993,79	R\$ 605.835,00

Quadro 35.

9.5 Taxa de Administração – PGJ/MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 74.213,96	R\$ 199.434,03
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 74.213,96	R\$ 199.434,03

TOTAL GERAL	R\$ 50.882.516,06	R\$ 41.464.511,15
--------------------	--------------------------	--------------------------

Quadro 36.

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
 Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MT13NDU4



10. RESUMO DAS MOVIMENTAÇÕES FINANCEIRAS

10.1 RENDA FIXA

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÃO	RESGATE	RENDIMENTO	SALDO	VARIAÇÃO (%)
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 7.057.946,27	R\$ -	R\$ 383.478,94	R\$ 445.870,34	R\$ 7.120.337,67	6,3173%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 317.176.278,77	R\$ 170.337.220,66	R\$ 12.169,57	R\$ 22.227.798,96	R\$ 509.729.128,82	7,0080%
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-
SANTANDER FIC IMA B INST. TP RF LP	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-
BRADESCO FI RF IRFM 1 TP	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 524.472.731,59	R\$ 18.819.302,36	R\$ 71.266.349,48	R\$ 20.342.019,51	R\$ 492.367.703,98	3,8786%
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 54.731.103,21	R\$ -	R\$ 2.710.481,70	R\$ 1.517.977,81	R\$ 53.538.599,32	2,7735%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 831.659.583,30	R\$ 13.058.128,98	R\$ 201.400.000,00	R\$ (2.764.823,19)	R\$ 640.552.889,09	-0,3324%
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 78.849.311,66	R\$ 30.000.000,00	R\$ 19.442.968,51	R\$ 3.993.266,21	R\$ 93.399.609,36	5,0644%
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 94.808.812,56	R\$ 54.584.144,36	R\$ 30.000.000,00	R\$ (6.929.776,36)	R\$ 112.463.180,56	-7,3092%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 60.799.000,01	R\$ 111.772.763,08	R\$ 30.063.249,42	R\$ (3.561.585,05)	R\$ 138.946.928,62	-5,8580%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 89.848.523,89	R\$ 517.958.582,98	R\$ 538.826.959,79	R\$ 1.476.090,03	R\$ 70.456.237,11	1,6429%
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 60.806.397,84	R\$ -	R\$ 4.300.559,16	R\$ 2.102.219,97	R\$ 58.608.058,65	3,4572%
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 9.324.667,93	R\$ 141.424.079,82	R\$ 113.763.974,74	R\$ 1.070.775,56	R\$ 38.055.548,57	11,4833%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 66.310.584,66	R\$ 98.068,57	R\$ 16.974.330,79	R\$ (251.830,28)	R\$ 49.182.492,16	-0,3798%
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 582.852.669,05	R\$ 23.331.898,77	R\$ 180.053.434,89	R\$ (3.366.072,59)	R\$ 422.765.060,34	-0,5775%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 64.400.324,94	R\$ -	R\$ 64.362.829,49	R\$ 75.624,08	R\$ 113.119,53	0,1174%
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 29.750.989,01	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.444.479,14	R\$ 31.195.468,15	4,8552%
ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ -	R\$ 60.472.572,27	R\$ -	R\$ 1.151.837,48	R\$ 61.624.409,75	1,9047%
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ -	R\$ 105.472.230,69	R\$ -	R\$ 2.180.282,69	R\$ 107.652.513,38	2,0672%
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ -	R\$ 33.472.230,68	R\$ -	R\$ 568.178,18	R\$ 34.040.408,86	1,6975%
BTG PACTUAL CRED CORP FIC FI RF CP	R\$ -	R\$ 34.804.274,91	R\$ -	R\$ 217.104,55	R\$ 35.021.379,46	0,6238%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 2.872.848.924,69	R\$ 1.315.605.498,13	R\$ 1.273.560.786,48	R\$ 41.939.437,04	R\$ 2.956.833.073,38	1,4599%

Quadro 37

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARÃES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRÉ LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

018

10.1 RENDA VARIÁVEL

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÃO	RESGATE	RENDIMENTO	SALDO	VARIAÇÃO (%)
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 46.127.497,79	R\$ 51.116.257,48	R\$ 65.715.541,26	-R\$ 2.796.363,67	R\$ 28.731.850,34	-6,062%
ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI	R\$ 27.767.520,90	R\$ -	R\$ 27.978.435,76	R\$ 210.914,86	R\$ (0,00)	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 10.665.485,89	R\$ 31.000.000,00	R\$ -	-R\$ 7.570.066,23	R\$ 34.095.419,66	-70,977%
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 128.292.874,16	R\$ 41.660.113,08	R\$ -	-R\$ 16.953.691,03	R\$ 152.999.296,21	-13,215%
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 105.039.692,39	R\$ 50.000.000,00	R\$ 28.000.000,00	-R\$ 4.251.022,40	R\$ 122.788.669,99	-4,047%
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 116.324.768,42	R\$ 303.588,63	R\$ 120.670.742,24	-R\$ 3.957.614,81	R\$ -	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 127.693.596,92	R\$ -	R\$ 128.754.103,29	R\$ 1.060.506,37	R\$ -	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 172.274.057,48	R\$ -	R\$ -	-R\$ 14.656.677,68	R\$ 157.617.379,80	-8,508%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 55.061.046,42	R\$ 65.754.103,29	R\$ -	-R\$ 16.628.359,77	R\$ 104.186.789,94	-30,200%
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 245.501.673,60	R\$ -	R\$ 150.000.000,00	-R\$ 18.308.972,12	R\$ 77.192.701,48	-7,458%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FI AÇÕES	R\$ -	R\$ 10.000.000,00	R\$ 4.256,77	-R\$ 2.053.937,10	R\$ 7.941.806,13	-20,539%
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 5.569.463,88	R\$ 6.721.536,12	R\$ -	R\$ 1.537.108,17	R\$ 13.828.108,17	27,599%
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 315.688.693,03	R\$ 20.000.000,00	R\$ -	-R\$ 106.739.199,80	R\$ 228.949.493,23	-33,812%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 104.192.666,47	R\$ -	R\$ 100.541.342,58	-R\$ 3.651.323,89	R\$ -	-3,504%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO 30	R\$ 48.825.960,46	R\$ -	R\$ 49.352.919,90	R\$ 526.959,44	R\$ 0,00	1,079%
SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 72.548.595,13	R\$ -	R\$ 71.660.113,08	-R\$ 876.154,28	R\$ 12.327,77	-1,208%
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 84.713.090,08	R\$ -	R\$ -	-R\$ 8.253.929,11	R\$ 76.459.160,97	-9,743%
OCCAM FIC FIA	R\$ 106.163.566,71	R\$ 29.000.000,00	R\$ 38.000.000,00	-R\$ 14.431.891,16	R\$ 82.731.675,55	-13,594%
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 33.658.143,72	R\$ -	R\$ -	-R\$ 6.853.577,87	R\$ 26.804.565,85	-20,362%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 21.663.161,65	R\$ 33.093.349,04	R\$ -	R\$ 9.767.418,00	R\$ 64.523.928,69	45,088%
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXTERIOR	R\$ 61.275.973,24	R\$ 71.541.342,58	R\$ -	R\$ 21.418.578,81	R\$ 154.235.894,63	34,954%
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 70.397.488,98	R\$ 60.000.000,00	R\$ -	R\$ 37.689.130,75	R\$ 168.086.619,73	53,538%
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 96.225.956,55	R\$ 30.143.086,19	R\$ -	R\$ 38.617.036,61	R\$ 164.986.079,35	40,132%
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 44.046.955,17	R\$ 57.561.020,85	R\$ 60.000.000,00	R\$ 16.630.564,59	R\$ 58.238.540,61	37,756%
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ -	R\$ 40.351.685,83	R\$ 12.252.505,29	R\$ 4.134.333,52	R\$ 32.233.514,06	10,246%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ -	R\$ 35.495.209,74	R\$ -	-R\$ 5.894.355,54	R\$ 41.389.565,28	16,606%
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ -	R\$ 35.495.209,75	R\$ -	-R\$ 1.077.900,80	R\$ 34.417.308,95	-3,037%
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 61.102.484,36	R\$ -	-R\$ 14.118.119,74	R\$ 46.984.364,62	-23,106%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ -	R\$ 51.819.785,23	R\$ 10.731.390,42	-R\$ 2.103.739,30	R\$ 38.984.655,51	-4,060%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ -	R\$ 10.000.000,00	R\$ -	-R\$ 1.869.685,06	R\$ 8.130.314,94	-18,697%
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ -	R\$ 93.367.031,84	R\$ -	R\$ 16.461.897,09	R\$ 109.828.928,93	17,631%
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ -	R\$ 121.034.230,58	R\$ -	-R\$ 23.363.686,88	R\$ 97.670.543,70	-19,303%
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ -	R\$ 9.515.813,90	R\$ -	-R\$ 259.618,05	R\$ 9.256.195,85	-2,728%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ -	R\$ 21.000.000,00	R\$ -	-R\$ 3.757.246,89	R\$ 17.242.753,11	-17,892%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QU	R\$ -	R\$ 31.670.742,24	R\$ -	-R\$ 607.252,09	R\$ 31.063.490,15	-1,917%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 40.000.000,00	R\$ -	-R\$ 1.192.036,00	R\$ 38.807.964,00	-2,9801%
BB AÇÕES QUANTITATIVO	R\$ -	R\$ 50.000.000,00	R\$ -	R\$ 145.820,90	R\$ 50.145.820,90	0,2916%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL	R\$ -	R\$ 24.543.768,62	R\$ -	R\$ 805.227,49	R\$ 25.348.996,11	3,2808%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 28.363.553,87	R\$ -	-R\$ 204.155,32	R\$ 28.159.398,55	-0,7198%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 2.099.717.929,04	R\$ 1.211.653.913,22	R\$ 863.661.350,59	R\$ (121.636.368,91)	R\$ 2.334.074.122,76	-5,4120%
TOTAL GERAL	R\$ 4.972.566.853,73	R\$ 2.527.259.411,35	R\$ 2.137.222.137,07	R\$ (79.696.931,87)	R\$ 5.290.907.196,14	-1,4418%

Quadro 38

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT13NDU4



11. ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS

11.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2021		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL	R\$ 752.788.585,51	12,46%	10,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
TOTAL art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 752.788.585,51				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 7.120.337,67	33,89%	22,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 509.729.128,82				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 492.367.703,98				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 53.538.599,32				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 640.552.889,09				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 93.399.609,36				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 112.463.180,56				
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 138.946.928,62				
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 2.048.118.377,42				
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 70.456.237,12	10,58%	13,00%	40,00%	art. 7º, inciso IV, "a"
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 38.055.548,57				
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.608.058,65				
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 49.182.492,16				
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 422.765.060,34				
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 113.119,53				
TOTAL art. 7º, inciso IV, "a"	R\$ 639.180.516,37				
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 31.195.468,15	4,46%	3,00%	5,00%	art. 7º, inciso VII, "b"
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 107.652.513,38				
ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 61.624.409,75				
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 35.021.379,46				
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 34.040.408,86				
TOTAL art. 7º, inciso VII, "b"	R\$ 269.534.179,60				
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 3.709.621.658,90	61,38%			

Quadro 39.

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT3NDU4



11.2 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Variável

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2021		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 28.731.850,34	0,48%	3,00%	30,00%	art 8º, inciso I, "a"
TOTAL art 8º, inciso I, "a"	R\$ 28.731.850,34				
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 38.807.964,00	23,64%	30,00%	30,00%	art. 8º, inciso II, "a"
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 76.459.160,97				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 122.788.669,99				
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 50.145.820,90				
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 8.130.314,94				
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 152.999.296,21				
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 46.984.364,62				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 228.949.493,23				
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 7.941.806,13				
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 31.063.490,15				
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 17.242.753,11				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 77.192.701,48				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 157.617.379,80				
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 34.095.419,66				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 104.186.789,94				
OCCAM FIC FIA	R\$ 82.731.675,55				
SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 12.327,77				
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 26.804.565,85				
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 97.670.543,70				
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 28.159.398,55				
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 38.984.655,51				
TOTAL art. 8º, inciso II, "a"	R\$ 1.428.968.592,06				
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 64.523.928,69	3,30%	3,00%	3,00%	art. 8º, inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 25.348.996,11				
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 109.828.928,93				
TOTAL art. 8º, inciso III	R\$ 199.701.853,73				
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 13.828.108,17	0,38%	2,00%	5,00%	art. 8º, inciso IV, "a"
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.256.195,85				
TOTAL art. 8º, inciso IV, "a"	R\$ 23.084.304,02				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.680.486.600,15	27,81%			

Quadro 40.

11.3 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Investimentos no Exterior

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 58.238.540,61	5,30%	5,00%	10,00%	art 9º-A, inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 41.389.565,28				
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 34.417.308,95				
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 154.235.894,63				
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 32.233.514,06				
TOTAL art 9º - A - II - Suífixo Investimento no Exterior	R\$ 320.514.823,53				
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 168.086.619,73	5,51%	5,00%		art 9º-A, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 164.986.079,35				
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 333.072.699,08				
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 653.587.522,61	10,81%			

TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 6.043.695.781,66	100%
-----------------------------------	-----------------------------	-------------

Quadro 41.

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT3NDU4



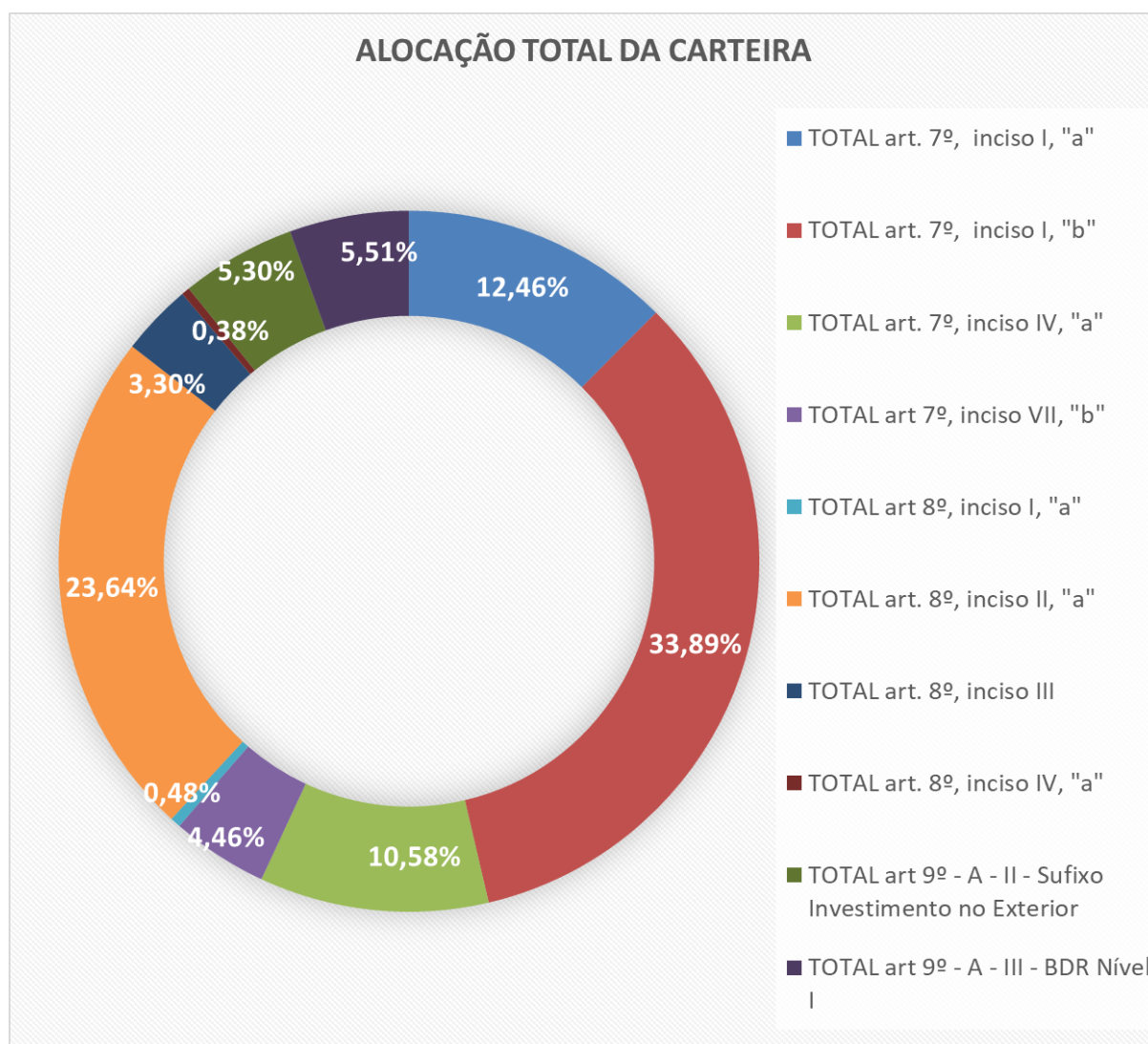


Gráfico 3.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
 Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MT3NDU4



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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% CARTEIRA	Resolução CMN nº 3.922/2010
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 38.807.964,00	0,63%	20%
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 76.459.160,97	1,24%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 168.086.619,73	2,73%	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 58.238.540,61	0,95%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 122.788.669,99	1,99%	
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 50.145.820,90	0,81%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 422.765.060,34	6,86%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 509.729.128,82	8,28%	
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 7.120.337,67	0,12%	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 8.130.314,94	0,13%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 49.182.492,16	0,80%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 38.055.548,57	0,62%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 152.999.296,21	2,48%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 28.731.850,34	0,47%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.608.058,65	0,95%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 70.456.237,12	1,14%	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 46.984.364,62	0,76%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 228.949.493,23	3,72%	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 13.828.108,17	0,22%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 7.941.806,13	0,13%	
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.256.195,85	0,15%	
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 35.021.379,46	0,57%	
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 25.348.996,11	0,41%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 53.538.599,32	0,87%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 492.367.703,98	7,99%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 640.552.889,09	10,40%	
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$ 31.063.490,15	0,50%	
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 107.652.513,38	1,75%	
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 17.242.753,11	0,28%	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 41.389.565,28	0,67%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 77.192.701,48	1,25%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 34.417.308,95	0,56%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 31.195.468,15	0,51%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 93.399.609,36	1,52%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 112.463.180,56	1,83%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 157.617.379,80	2,56%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 113.119,53	0,00%	
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 109.828.928,93	1,78%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 104.186.789,94	1,69%	
ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 61.624.409,75	1,00%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 34.095.419,66	0,55%	
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 34.040.408,86	0,55%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 82.731.675,55	1,34%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 164.986.079,35	2,68%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 138.946.928,62	2,26%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 64.523.928,69	1,05%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 154.235.894,63	2,50%	
SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 12.327,77	0,00%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 32.233.514,06	0,52%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 26.804.565,85	0,44%	
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 97.670.543,70	1,59%	
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 28.159.398,55	0,46%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 38.984.655,51	0,63%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO	R\$ 5.290.907.196,15		

Quadro 42.

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

023

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.

11.5 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 TP VII - 15/08/2022	R\$ 7.120.337,67	R\$ 248.037.532,98	2,87%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 509.729.128,82	R\$ 9.277.694.744,55	5,49%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 422.765.060,34	R\$ 7.701.081.218,58	5,49%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 122.788.669,99	R\$ 1.098.659.963,05	11,18%	
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 50.145.820,90	R\$ 1.417.181.864,81	3,54%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 168.086.619,73	R\$ 2.396.743.051,17	7,01%	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 58.238.540,61	R\$ 2.529.172.574,05	2,30%	
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 70.456.237,12	R\$ 631.584.812,26	11,16%	
BRANCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 38.055.548,57	R\$ 3.276.976.164,01	1,16%	
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.608.058,65	R\$ 1.241.205.562,42	4,72%	
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 49.182.492,16	R\$ 1.152.512.113,97	4,27%	
BRANCO INST IBR X ALPHA	R\$ 28.731.850,34	R\$ 503.177.927,29	5,71%	
BRANCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 152.999.296,21	R\$ 1.419.483.989,90	10,78%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 492.367.703,98	R\$ 12.444.051.491,75	3,96%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 53.538.599,32	R\$ 218.489.919,55	24,50%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 640.552.889,09	R\$ 12.561.638.596,69	5,10%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 113.119,53	R\$ 2.626.754.965,66	0,00%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 34.095.419,66	R\$ 723.867.535,77	4,71%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 157.617.379,80	R\$ 2.631.453.374,95	5,99%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 104.186.789,94	R\$ 923.668.055,52	11,28%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 12.327,77	R\$ 166.923.439,39	0,01%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 154.235.894,63	R\$ 2.180.881.081,62	7,07%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 77.192.701,48	R\$ 999.787.061,37	7,72%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 93.399.609,36	R\$ 824.519.977,45	11,33%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 112.463.180,56	R\$ 604.309.300,74	18,61%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 138.946.928,62	R\$ 1.091.655.164,39	12,73%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 228.949.493,23	R\$ 1.896.702.011,80	12,07%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 164.986.079,35	R\$ 3.983.843.860,12	4,14%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 76.459.160,97	R\$ 1.900.035.039,47	4,02%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 82.731.675,55	R\$ 1.010.020.909,77	8,19%	
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 97.670.543,70	R\$ 1.094.729.532,50	8,92%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 26.804.565,85	R\$ 368.066.288,15	10,59%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 38.984.655,51	R\$ 542.903.933,54	5,72%	
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT	R\$ 31.063.490,15	R\$ 506.222.631,32	6,14%	
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 38.807.964,00	R\$ 873.571.747,14	4,44%	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 41.389.565,28	R\$ 135.056.267.739,99	0,03%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 34.417.308,95	R\$ 37.339.613.996,37	0,09%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 7.941.806,13	R\$ 87.352.824,95	9,09%	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 8.130.314,94	R\$ 205.904.381,47	3,95%	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 46.984.364,62	R\$ 476.428.583,05	9,86%	
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 17.242.753,11	R\$ 154.789.214,50	11,14%	
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 28.159.398,55	R\$ 703.850.641,65	4,00%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 32.233.514,06	R\$ 19.919.461.267,17	0,16%	
TOTAL	R\$ 4.798.586.858,80			

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14, § 1º	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Resolução CMN nº 3.922/2010
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 64.523.928,69	R\$ 2.394.295.587,10	2,69%	5%
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 109.828.928,93	R\$ 2.374.573.482,34	4,63%	
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 25.348.996,11	R\$ 385.338.764,40	6,58%	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 13.828.108,17	R\$ 993.885.542,59	1,39%	
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.256.195,85	R\$ 186.152.675,59	4,97%	
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 35.021.379,46	R\$ 1.405.415.305,82	2,49%	
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 34.040.408,86	R\$ 777.989.992,71	4,38%	
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 107.652.513,38	R\$ 1.904.562.600,94	5,65%	
ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 61.624.409,75	R\$ 1.907.070.007,57	3,23%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 31.195.468,15	R\$ 1.086.649.624,61	2,87%	
TOTAL	R\$ 492.320.337,35			
TOTAL	R\$ 5.290.907.196,15			

Quadro 43.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT13NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

024

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

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

Nota 3: Art. 14 § 3º. Em caso de os limites de que tratam o caput e o § 1º deste artigo serem ultrapassados em decorrência de resgate de cotas do fundo por outros cotistas, o regime próprio de previdência social deverá adequar-se em até 120 dias. Nesse caso, registra-se o fundo Icatu Vanguarda Inflação Longa FI RF (CNPJ: 10.756.541/0001-06);

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

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA NOVEMBRO/2021) EM R\$ MI	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (DEZEMBRO/2021)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB DTVM S.A	R\$ 1.439.434,96	R\$ 1.338.874.178,06	0,0930%	5%
CAIXA	R\$ 420.388,15	R\$ 1.217.522.682,54	0,2896%	
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 574.744,24	R\$ 467.466.047,61	0,0813%	
BANCO SAFRA	R\$ 105.879,73	R\$ 368.456.936,66	0,3480%	
BRADESCO	R\$ 550.350,66	R\$ 398.033.483,05	0,0723%	
ICATÚ VANGUARDA DTVM S/A	R\$ 34.408,75	R\$ 314.250.959,55	0,9133%	
BANCO BTG	R\$ 209.137,40	R\$ 320.345.978,95	0,1532%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	R\$ 305.005,20	R\$ 261.900.735,78	0,0859%	
VINCI PARTNERS	R\$ 42.469,53	R\$ 136.655.199,21	0,3218%	
OCCAM BRASIL GESTÃO	R\$ 14.652,83	R\$ 82.731.675,55	0,5646%	
PLURAL INVEST GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 35.871,89	R\$ 75.806.874,23	0,2113%	
AZ QUEST INVESTIMENTOS	R\$ 16.259,11	R\$ 76.459.160,97	0,4703%	
BC GESTAO RECURSOS LTDA	R\$ 7.191,10	R\$ 46.984.364,62	0,6534%	
ARX INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 35.272,51	R\$ 38.807.964,00	0,1100%	
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL LTDA	R\$ 23.109,64	R\$ 32.233.514,06	0,1395%	
MONGERAL AEGON	R\$ 8.602,73	R\$ 34.040.408,86	0,3957%	
SUL AMERICA INVESTIMENTOS	R\$ 28.481,18	R\$ 26.804.565,85	0,0941%	
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT ADM REC LTDA	R\$ 7.534,67	R\$ 17.242.753,11	0,2288%	
GUEPARDO INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 1.629,47	R\$ 28.159.398,55	1,7281%	
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	R\$ 56.771,92	R\$ 8.130.314,94	0,0143%	

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.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT13NDU4



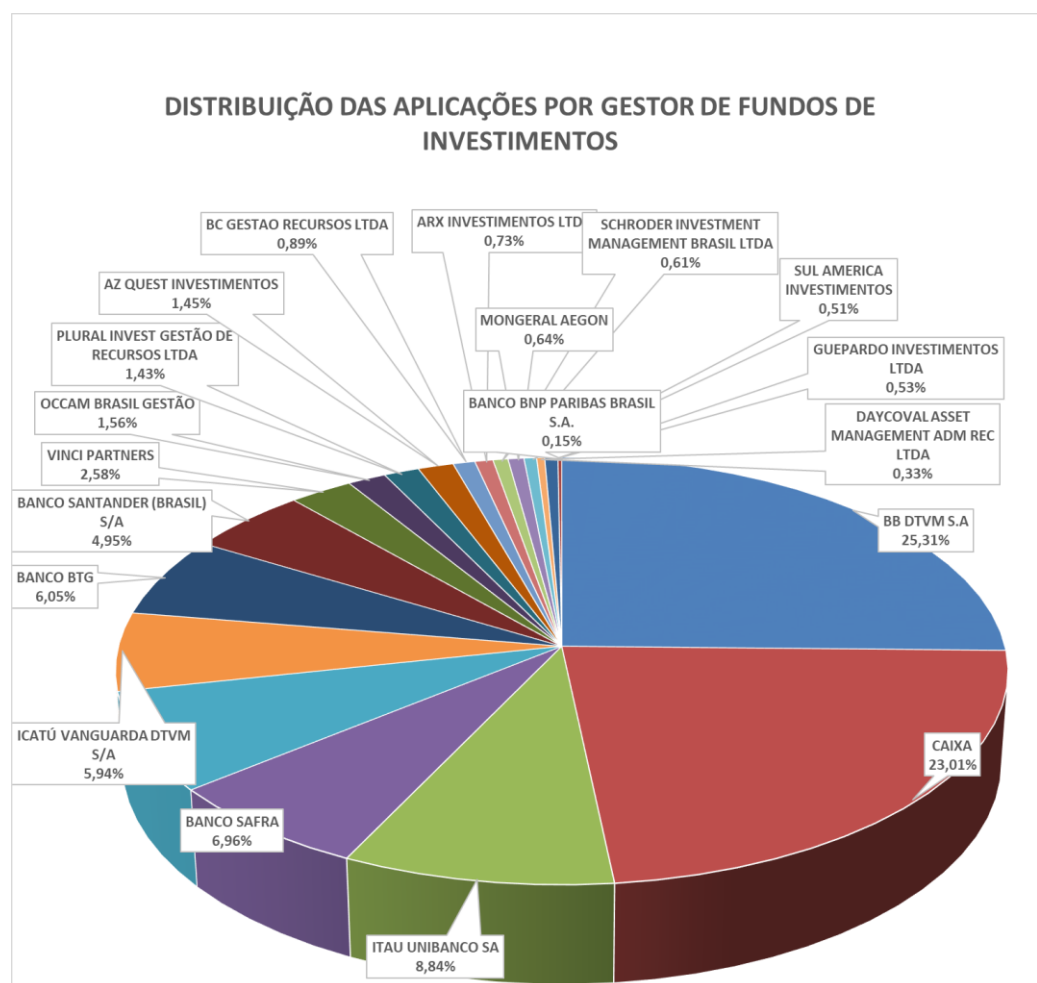


Gráfico 4.

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 5.290.907.196,15
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 752.788.585,51
TÍTULOS - CVS	R\$ 8.712.029,37
IMÓVEIS	R\$ 68.293.435,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 39.050.926,31
TOTAL	R\$ 6.159.752.172,34

Quadro 45.

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldossegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT3NDU4



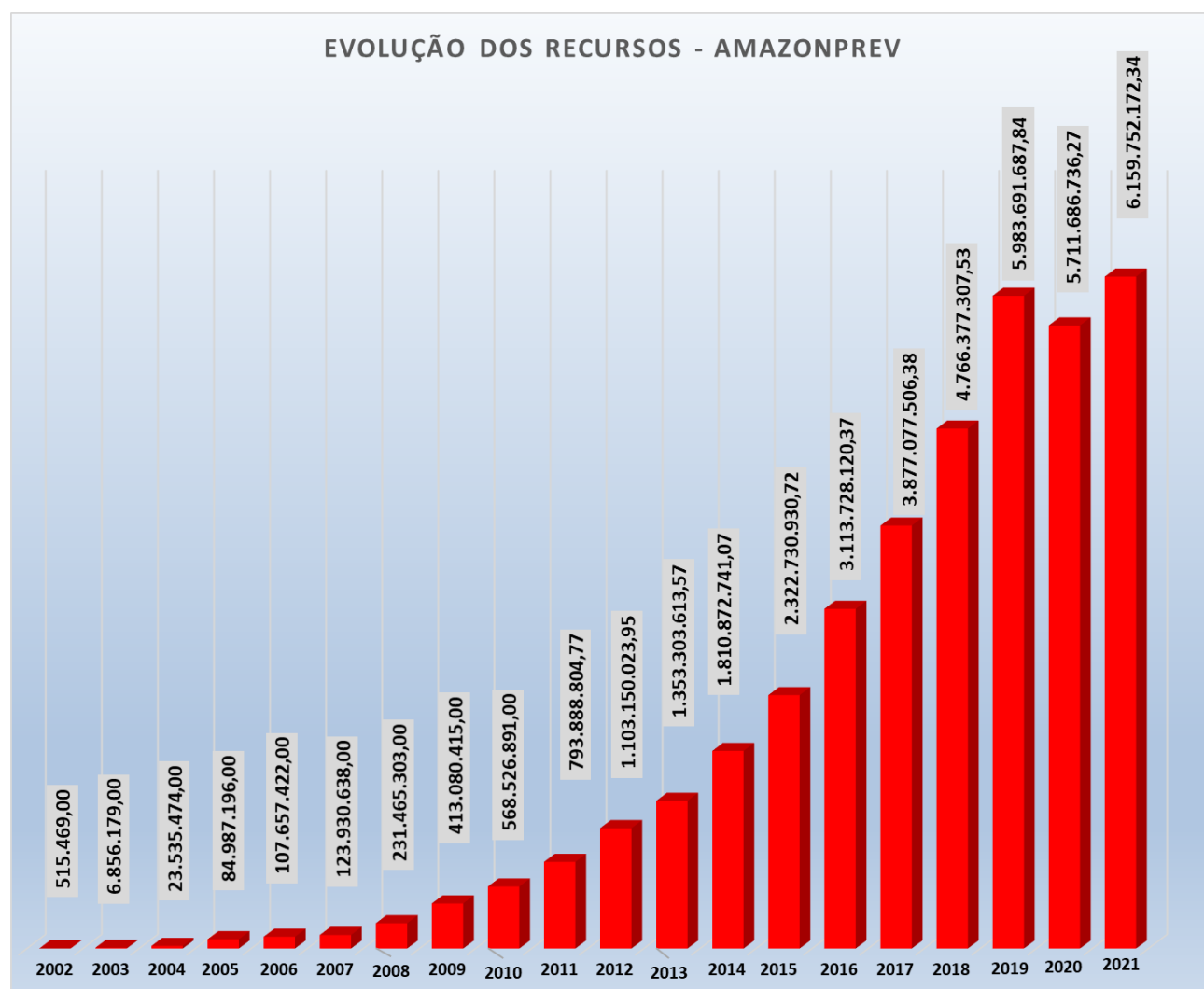


Gráfico 05.



AMAZONPREV
Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



RELATÓRIO DE RISCOS FPREV - AMAZONPREV

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

028

TOTAL RENDA FIXA	R\$	3.592.885.298,29
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$	1.661.420.852,88
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$	653.587.522,61
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$	5.907.893.673,78

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso I, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M RETORNO	dez/21 RETORNO	2021 RETORNO
TÍTULOS PÚBLICOS DO TESOURO	R\$ 743.334.839,23	R\$ 752.788.585,51							
TOTAL - art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 743.334.839,23	R\$ 752.788.585,51							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso I, "b"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M RETORNO	dez/21 RETORNO	2021 RETORNO
BB Prev RF Tit Publ VII FI	R\$ 7.079.089,17	R\$ 7.120.337,67	0,20	1,62%	0,17%	-0,95	6,57%	0,58%	6,57%
Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	R\$ 53.088.094,00	R\$ 53.538.599,32	0,20	5,15%	0,53%	-1,01	-2,18%	0,85%	-2,18%
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	R\$ 488.617.878,32	R\$ 492.367.703,98	0,20	2,77%	0,29%	-2,29	4,31%	0,77%	4,31%
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	R\$ 595.078.999,88	R\$ 599.992.481,32	0,40	2,32%	0,24%	-1,00	-0,11%	0,83%	-0,11%
Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	R\$ 92.691.813,36	R\$ 93.399.609,36	0,25	2,81%	0,29%	-2,29	4,14%	0,76%	4,14%
Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	R\$ 112.883.548,91	R\$ 112.463.180,56	0,25	9,09%	0,94%	0,00	-6,96%	-0,37%	-6,96%
Safra Ima Institucional Fc FI RF	R\$ 136.099.023,98	R\$ 138.946.928,62	0,20	6,49%	0,67%	0,00	-4,86%	-0,10%	-4,86%
BB Prev RF Idka 2 FI	R\$ 506.154.654,50	R\$ 509.729.128,82	0,20	2,61%	0,27%	-2,26	4,65%	0,71%	4,65%
TOTAL - art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 1.991.693.102,12	R\$ 2.007.557.969,65							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso IV, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M RETORNO	dez/21 RETORNO	2021 RETORNO
BB Prev RF Alocacao Ativa Fcfl	R\$ 468.639.244,19	R\$ 422.765.060,34	0,50	2,83%	0,29%	0,00	-0,40%	0,91%	-0,40%
Bradesco Fc FI RF Alocacao Dinamica	R\$ 48.800.475,79	R\$ 49.182.492,16	0,40	2,68%	0,28%	0,00	-0,16%	0,78%	-0,16%
Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	R\$ 58.516.836,21	R\$ 58.608.058,65	0,20	2,92%	0,30%	-2,32	3,67%	0,77%	3,67%
Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	R\$ 299.531,26	R\$ 75.287,33	0,20	0,14%	0,01%	0,00	4,21%	0,69%	4,21%
Itau Instit Alocacao Dinamica RF FICFI	R\$ 112.154,15	R\$ 113.119,53	0,40	1,10%	0,11%	-1,05	4,53%	0,86%	4,53%
Bradesco FI RF Ref DI Premium	R\$ 32.001.271,71	R\$ 32.260.545,52	0,20	0,16%	0,02%	0,00	4,94%	0,81%	4,94%
TOTAL - art. 7º, inciso IV, "a"	R\$ 608.369.513,31	R\$ 563.004.563,53							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso VII, "b"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M RETORNO	dez/21 RETORNO	2021 RETORNO
Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	R\$ 30.854.744,78	R\$ 31.195.468,15	0,40	3,93%	0,41%	-3,99	4,86%	1,10%	4,86%
Mongeral Aegon Cred Priv FI RF LP	R\$ 25.973.110,33	R\$ 34.040.408,86	0,45	0,30%	0,03%	-0,06	6,29%	0,84%	6,29%
Sant RF Cred Priv Crescimento Inst FI LP	R\$ 99.044.974,59	R\$ 107.652.513,38	0,30	0,36%	0,04%	-0,05	5,99%	0,77%	5,99%
BTG Pact Cre Cor I FICFI RF Cred Priv	R\$ 7.702.655,51	R\$ 35.021.379,46	0,60	0,52%	0,05%	-0,10	8,16%	0,74%	8,16%
Itau High Grade RF Cred Priv FICFI	R\$ 53.345.940,97	R\$ 61.624.409,75	0,25	0,26%	0,03%	-0,03	5,16%	0,81%	5,16%
TOTAL - art. 7º, inciso VII, "b"	R\$ 216.921.426,18	R\$ 269.534.179,60							

Quadro 1.

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT13NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

029

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso I, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M RETORNO	dez/21 RETORNO	2021 RETORNO
Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	R\$ 27.930.416,82	R\$ 28.731.850,34	0,90	20,48%	2,11%	-10,90	-15,28%	2,87%	-15,28%
TOTAL - art. 8º, inciso I, "a"	R\$ 27.930.416,82	R\$ 28.731.850,34							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso II, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M RETORNO	dez/21 RETORNO	2021 RETORNO
BB Ações Valor FICFIA	R\$ 117.978.963,89	R\$ 122.788.669,99	2,00	19,99%	2,06%	-15,12	-4,76%	4,08%	-4,76%
Bradesco FIA Mid Small Caps	R\$ 147.266.685,61	R\$ 152.999.296,21	1,50	22,55%	2,32%	-10,17	-9,84%	3,89%	-9,84%
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	R\$ 230.529.545,52	R\$ 228.949.493,23	3,00	23,83%	2,45%	-9,04	-31,79%	-0,69%	-31,79%
Caixa FIA Consumo	R\$ -	R\$ -	1,60	23,53%	2,42%	-10,57	-26,98%	-0,02%	-26,98%
Icatu Vanguarda Dividendos FIA	R\$ 76.484.317,50	R\$ 77.192.701,48	2,00	18,24%	1,88%	-9,60	-18,26%	0,93%	-18,26%
Itau Acoes Dunamis Fc	R\$ 156.101.613,81	R\$ 157.617.379,80	2,00	17,88%	1,84%	-6,97	-8,51%	0,97%	-8,51%
Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	R\$ 33.466.421,25	R\$ 34.095.419,66	2,50	20,30%	2,09%	-10,50	-16,64%	1,88%	-16,64%
Itau Institucional Acoes Phoenix Fc	R\$ -	R\$ -	2,00	22,41%	2,31%	-11,17	-17,09%	0,39%	-17,09%
Itau Small Cap Valuation Fc Acoes	R\$ 100.650.594,60	R\$ 104.186.789,94	2,00	23,55%	2,43%	-9,66	-10,06%	3,51%	-10,06%
Sant Seleo Cresc Senior Acoes Fc FI	R\$ 12.064,20	R\$ 12.327,77	2,50	21,04%	2,16%	-12,22	-20,59%	2,18%	-20,59%
Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes	R\$ -	R\$ -	0,75	20,79%	2,14%	-11,97	-13,46%	2,86%	-13,46%
Sant Seleo Crescimento Acoes Fc FI	R\$ -	R\$ -	2,00	21,03%	2,16%	-12,23	-20,54%	2,18%	-20,54%
Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	R\$ 74.798.444,07	R\$ 76.459.160,97	2,00	19,15%	1,97%	-10,73	-9,74%	2,22%	-9,74%
Occam Fc de FIA	R\$ 79.939.581,88	R\$ 82.731.675,55	2,50	20,06%	2,07%	-12,30	-12,74%	3,49%	-12,74%
Sul America Equities FIA	R\$ 25.543.886,19	R\$ 26.804.565,85	1,50	20,90%	2,15%	-11,50	-20,36%	4,94%	-20,36%
BTG Pactual Dividendos FIC FIA	R\$ 7.886.600,35	R\$ 7.941.806,13	2,50	19,11%	1,97%	-9,78	-19,00%	0,73%	-19,00%
Vinci Mosaico Institucional FIA	R\$ 97.551.401,37	R\$ 97.670.543,70	1,97	20,54%	2,12%	-10,27	-12,82%	0,12%	-12,82%
Vinci Selection Equities FIA	R\$ 34.255.367,85	R\$ 38.984.655,51	4,00	18,66%	1,92%	-10,60	-11,49%	2,66%	-11,49%
Brasil Capital Rp Inst Fc de FIA	R\$ 45.872.728,26	R\$ 46.984.364,62	3,12			-5,83		2,42%	
Bnpp Action Fc FIA	R\$ 7.836.757,83	R\$ 8.130.314,94	2,02	19,94%	2,05%	-11,80	-16,02%	3,75%	-16,02%
Daycoval Ibovespa Ativo FIA	R\$ 16.548.724,79	R\$ 17.242.753,11	3,50	21,49%	2,21%	-11,29	-18,36%	4,19%	-18,36%
Cx FIC FIA BR Acoes Livre Quantitativo	R\$ 11.342.056,59	R\$ 11.997.742,88	2,00	20,99%	2,16%	-7,51	5,61%	5,78%	5,61%
Guepardo Institucional FIC FIA	R\$ -	R\$ 28.159.398,55	2,05	25,04%	2,58%	-14,33	9,85%	-0,34%	9,85%
BB Acoes Quantitativo Fc	R\$ -	R\$ 50.145.820,90	2,00	19,59%	2,02%	-14,31	-6,26%	3,56%	-6,26%
ARX Income Inst Fc FIA	R\$ 37.533.248,57	R\$ 38.807.964,00	2,32	19,46%	2,00%	-10,58	-6,50%	3,40%	-6,50%
TOTAL - art. 8º, inciso II, "a"	R\$ 1.301.599.004,13	R\$ 1.409.902.844,79							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso III	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M RETORNO	dez/21 RETORNO	2021 RETORNO
Safra S P Reais Pb FI Mult	R\$ 61.204.048,00	R\$ 64.523.928,69	1,00	13,22%	1,36%	-5,08	32,11%	5,42%	32,11%
BTG Pactual S&P 500 Brl FI Mult	R\$ -	R\$ 25.348.996,11	0,20	13,44%	1,39%	-5,10	33,76%	5,48%	33,76%
Itau Private Mult S&P500 Brl Fc	R\$ 104.058.940,69	R\$ 109.828.928,93	0,80	13,38%	1,38%	-5,12	32,74%	5,54%	32,74%
TOTAL - art. 8º, inciso III	R\$ 165.262.988,69	R\$ 199.701.853,73							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso IV, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M RETORNO	dez/21 RETORNO	2021 RETORNO
BTG Pactual Economia Real FI Partic Mult	R\$ 13.877.804,75	R\$ 13.828.108,17	2,00			-5,90	13,62%	-0,36%	13,62%
BTG Pa Inv de Im FI Participac Mult Cl A	R\$ 9.309.964,96	R\$ 9.256.195,85	2,15			0,00		-0,58%	
TOTAL - art. 8º, inciso IV, "a"	R\$ 23.187.769,71	R\$ 23.084.304,02							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M RETORNO	dez/21 RETORNO	2021 RETORNO
BB Mult Global Select Equity Ie FI	R\$ 56.000.961,48	R\$ 58.238.540,61	0,08	17,65%	1,83%	-10,91	32,35%	4,00%	32,35%
Sant Global Equi Dolar Mas Mult Ie Fc FI	R\$ 152.880.147,40	R\$ 154.235.894,63	1,00	16,24%	1,68%	-11,57	23,65%	0,89%	23,65%
Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	R\$ 31.713.226,62	R\$ 32.233.514,06	1,00	17,38%	1,80%	-9,75	28,48%	1,64%	28,48%
Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	R\$ 39.539.540,73	R\$ 34.417.308,95	0,80	32,67%	3,36%	-24,25	5,29%	-12,95%	5,29%
Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	R\$ 39.523.473,43	R\$ 41.389.565,28	0,80	18,03%	1,86%	-10,58	23,24%	4,72%	23,24%
TOTAL - art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 319.657.349,66	R\$ 320.514.823,53							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR TOTAL art 9º - A - III - BDR Nivel I	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M RETORNO	dez/21 RETORNO	2021 RETORNO
BB Acoes Esg FIA - Bdr Nivel I	R\$ 163.204.312,77	R\$ 168.086.619,73	0,50	17,23%	1,78%	-11,63	33,49%	2,99%	33,49%
Safra Consumo Americano FIA Bdr Nivel I	R\$ 159.482.829,04	R\$ 164.986.079,35	1,50	17,50%	1,81%	-10,16	33,92%	3,45%	33,92%
TOTAL - TOTAL art 9º - A - III - BDR Nivel I	R\$ 322.687.141,81	R\$ 333.072.699,08							

Quadro 2.

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

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>

e valide o código: MT3NDU4



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

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

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

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

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ

Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>

e valide o código: MT3NDU4



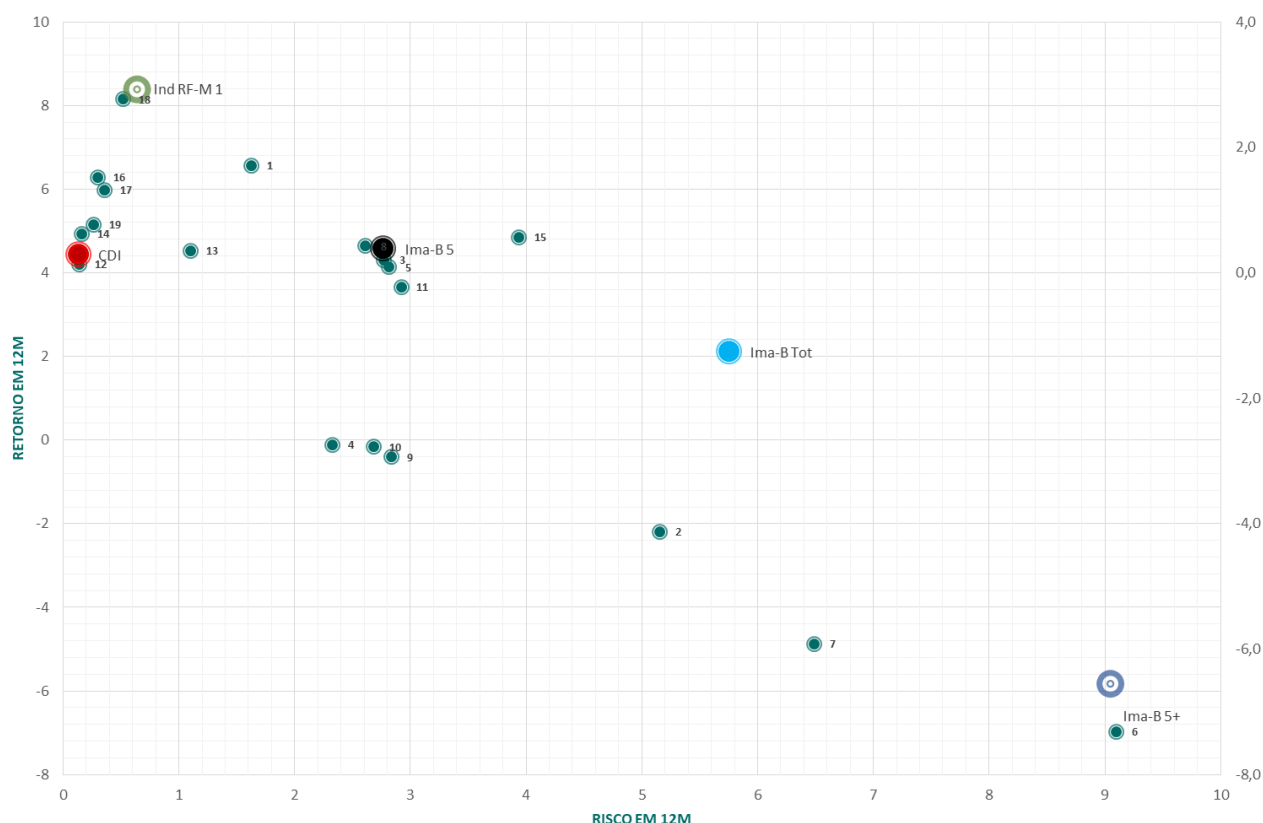


Gráfico 1: Art. 7º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art. 7º, inciso I, "b"	BB Prev RF Tit Publ VII FI	6,57	1,62	D+000	D+000
2	art. 7º, inciso I, "b"	Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	-2,18	5,15	D+000	D+000
3	art. 7º, inciso I, "b"	FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	4,31	2,77	D+000	D+000
4	art. 7º, inciso I, "b"	Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	-0,11	2,32	D+000	D+000
5	art. 7º, inciso I, "b"	Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	4,14	2,81	D+000	D+001
6	art. 7º, inciso I, "b"	Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	-6,96	9,09	D+000	D+001
7	art. 7º, inciso I, "b"	Safra Ima Institucional Fc FI RF	-4,86	6,49	D+003	D+004
8	art. 7º, inciso I, "b"	BB Prev RF Idka 2 FI	4,65	2,61	D+001	D+001
9	art. 7º, inciso IV, "a"	BB Prev RF Alocacao Ativa Fc fi	-0,40	2,83	D+003	D+003
10	art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco Fc FI RF Alocacao Dinamica	-0,16	2,68	D+003	D+004
11	art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	3,67	2,92	D+001	D+001
12	art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	4,21	0,14	D+000	D+000
13	art. 7º, inciso IV, "a"	Itau Instit Alocacao Dinamica RF FICFI	4,53	1,10	D+000	D+001
14	art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco FI RF Ref DI Premium	4,94	0,16	D+000	D+000
15	art. 7º, inciso VII, "b"	Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	4,86	3,93	D+005	D+006
16	art. 7º, inciso VII, "b"	Mongeral Aegon Cred Priv FI RF LP	6,29	0,30	D+000	D+001
17	art. 7º, inciso VII, "b"	Sant RF Cred Priv Crescimento Inst FI LP	5,99	0,36	D+000	D+001
18	art. 7º, inciso VII, "b"	BTG Pact Cre Cor I FICFI RF Cred Priv	8,16	0,52	D+030	D+031
19	art. 7º, inciso VII, "b"	Itau High Grade RF Cred Priv FICFI	5,16	0,26	D+000	D+000

Quadro 2. Legenda Gráfico 1.

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT3NDU4



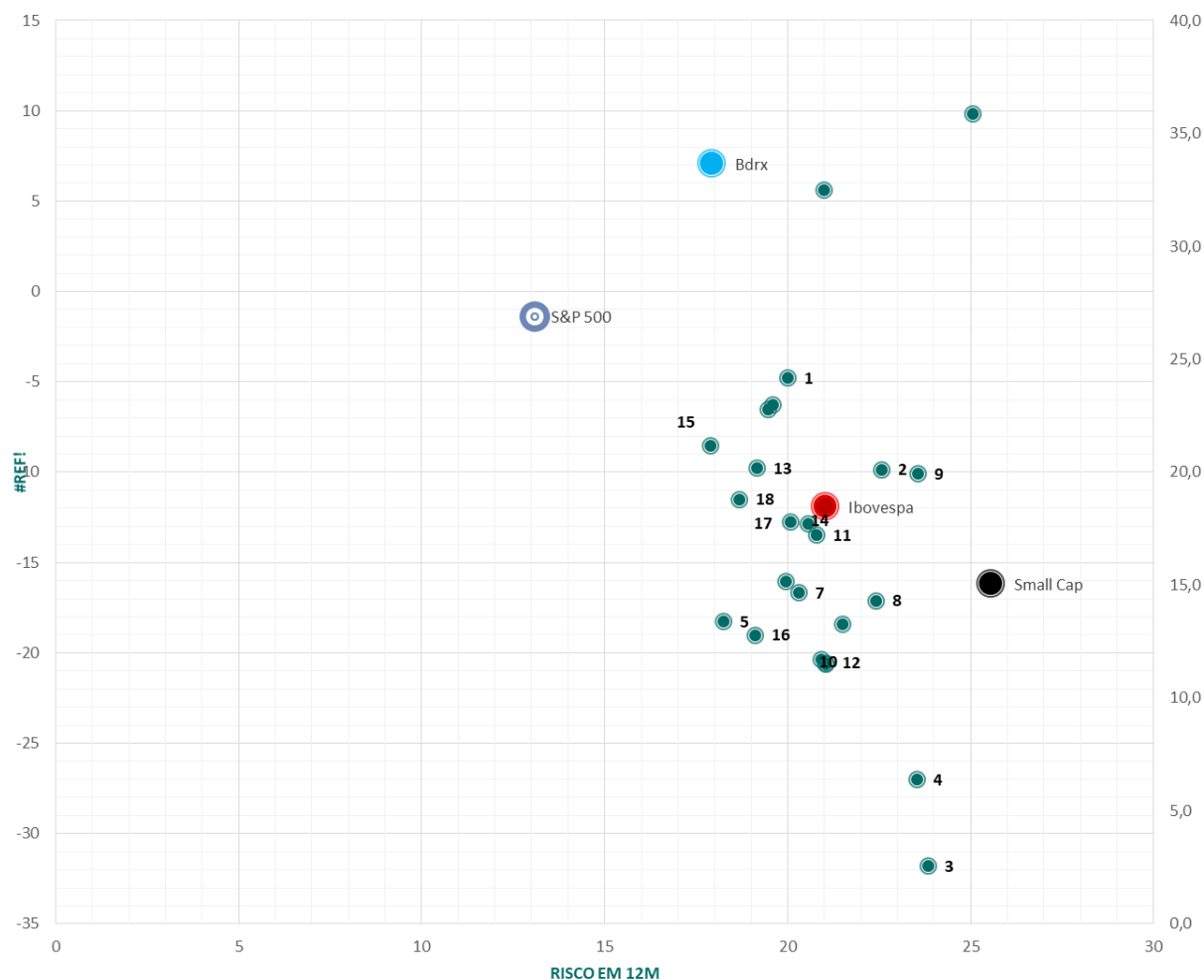


Gráfico 2: Art. 8º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

033

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art. 8º, inciso II, "a"	BB Ações Valor FICFIA	-4,76	19,99	D+030	D+032
2	art. 8º, inciso II, "a"	Bradesco FIA Mid Small Caps	-9,84	22,55	D+001	D+003
3	art. 8º, inciso II, "a"	BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	-31,79	23,83	D+001	D+032
4	art. 8º, inciso II, "a"	Caixa FIA Consumo	-26,98	23,53	D+001	D+003
5	art. 8º, inciso II, "a"	Icatu Vanguarda Dividendos FIA	-18,26	18,24	D+001	D+003
6	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Acoes Dunamis Fc	-8,51	17,88	D+021	D+023
7	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	-16,64	20,30	D+002	D+002
8	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Institucional Acoes Phoenix Fc	-17,09	22,41	D+021	D+023
9	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Small Cap Valuation Fc Acoes	-10,06	23,55	D+001	D+003
10	art. 8º, inciso II, "a"	Sant Seleo Cresc Senior Acoes Fc FI	-20,59	21,04	D+001	D+003
11	art. 8º, inciso II, "a"	Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes	-13,46	20,79	D+001	D+003
12	art. 8º, inciso II, "a"	Sant Seleo Crescimento Acoes Fc FI	-20,54	21,03	D+027	D+029
13	art. 8º, inciso II, "a"	Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	-9,74	19,15	D+027	D+029
14	art. 8º, inciso II, "a"	Occam Fc de FIA	-12,74	20,06	D+001	D+003
15	art. 8º, inciso II, "a"	Sul America Equities FIA	-20,36	20,90	D+001	D+003
16	art. 8º, inciso II, "a"	BTG Pactual Dividendos FIC FIA	-19,00	19,11	D+001	D+003
17	art. 8º, inciso II, "a"	Vinci Mosaico Institucional FIA	-12,82	20,54	D+001	D+003
18	art. 8º, inciso II, "a"	Vinci Selection Equities FIA	-11,49	18,66	D+060	D+062
19	art. 8º, inciso II, "a"	Brasil Capital Rp Inst Fc de FIA			D+030	D+032
20	art. 8º, inciso II, "a"	Bnpp Action Fc FIA	-16,02	19,94	D+027	D+029
21	art. 8º, inciso II, "a"	Daycoval Ibovespa Ativo FIA	-18,36	21,49	D+012	D+014
22	art. 8º, inciso II, "a"	Cx FIC FIA BR Acoes Livre Quantitativo	5,61	20,99	D+013	D+015
23	art. 8º, inciso II, "a"	ARX Income Inst Fc FIA	-6,50	19,46	D+001	D+003
24	art. 8º, inciso II, "a"	BB Acoes Quantitativo Fc	-6,26	19,59	D+001	D+003
25	art. 8º, inciso II, "a"	Guepardo Institucional FIC FIA	9,85	25,04	D+030	D+032

Quadro 3. Legenda Gráfico 2.

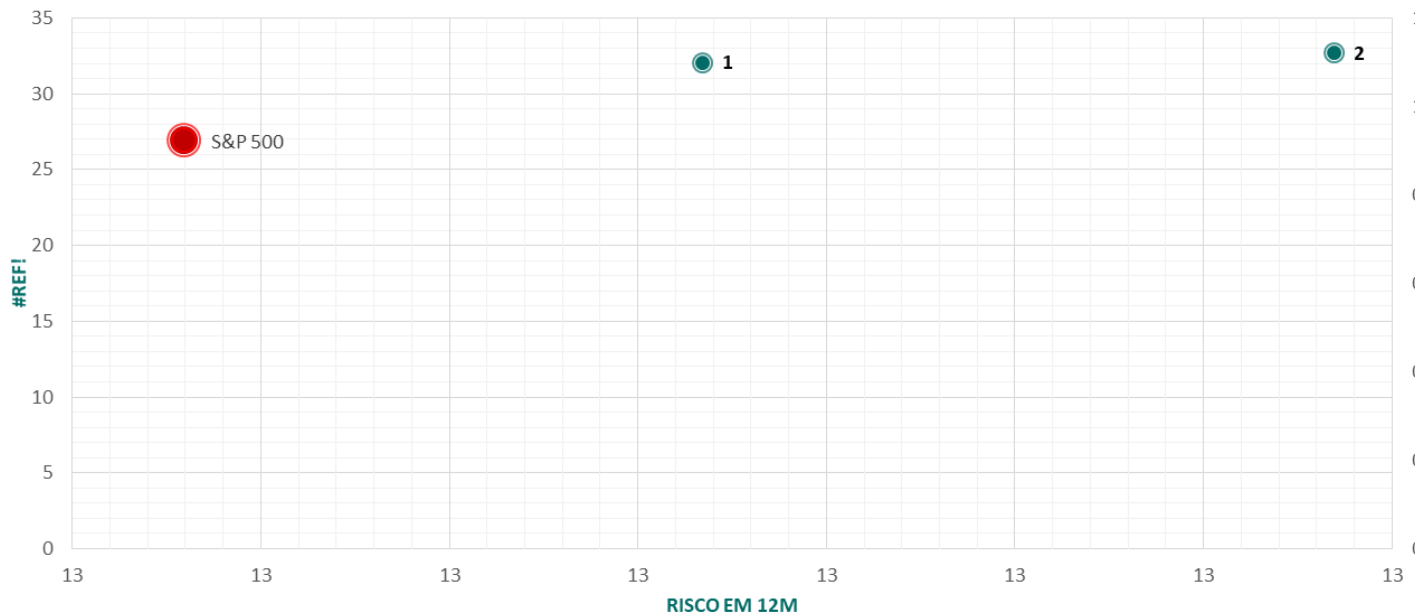


Gráfico 3: Art. 8-III,º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art. 8º, inciso III	Safra S P Reais Pb FI Mult	32,11	13,22	D+001	D+002
2	art. 8º, inciso III	Itau Private Mult S&P500 Brl Fc	32,74	13,38	D+000	D+001

Quadro 4. Legenda Gráfico 3.

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT13NDU4



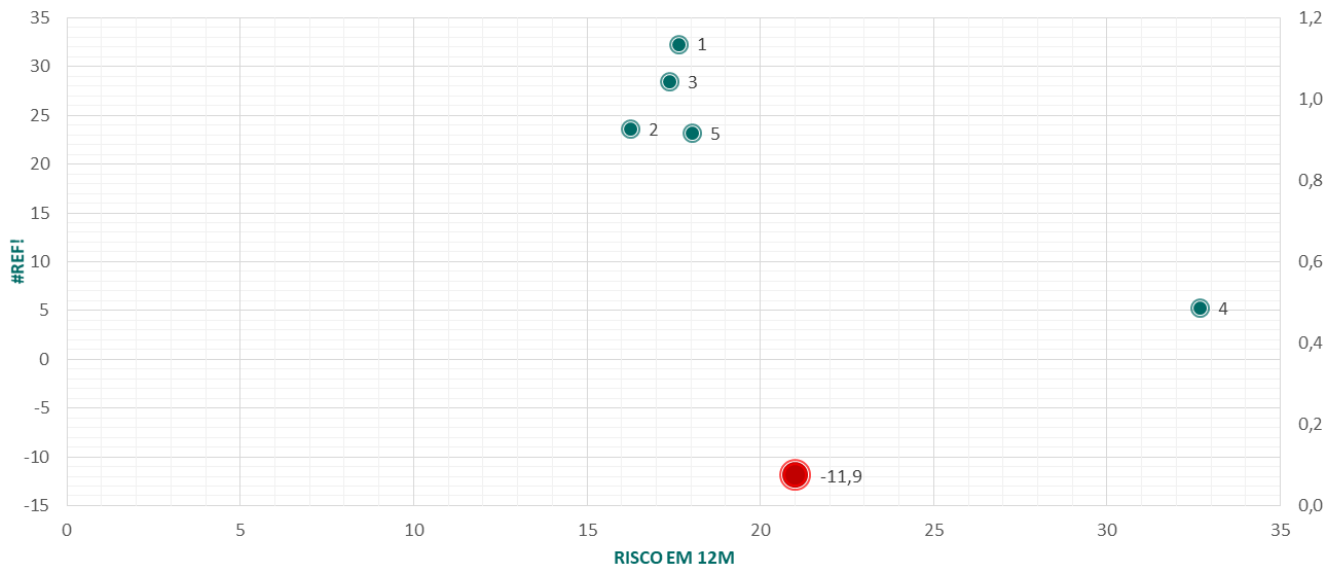


Gráfico 4: Art. 9º-A-II Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	BB Mult Global Select Equity Ie FI	32,35	17,65	D+001	D+005
2	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Sant Global Equi Dolar Mas Mult Ie Fc FI	23,65	16,24	D+001	D+008
3	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	28,48	17,38	D+001	D+004
4	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	5,29	32,67	D+001	D+006
5	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	23,24	18,03	D+001	D+006

Quadro 5. Legenda Gráfico 4.

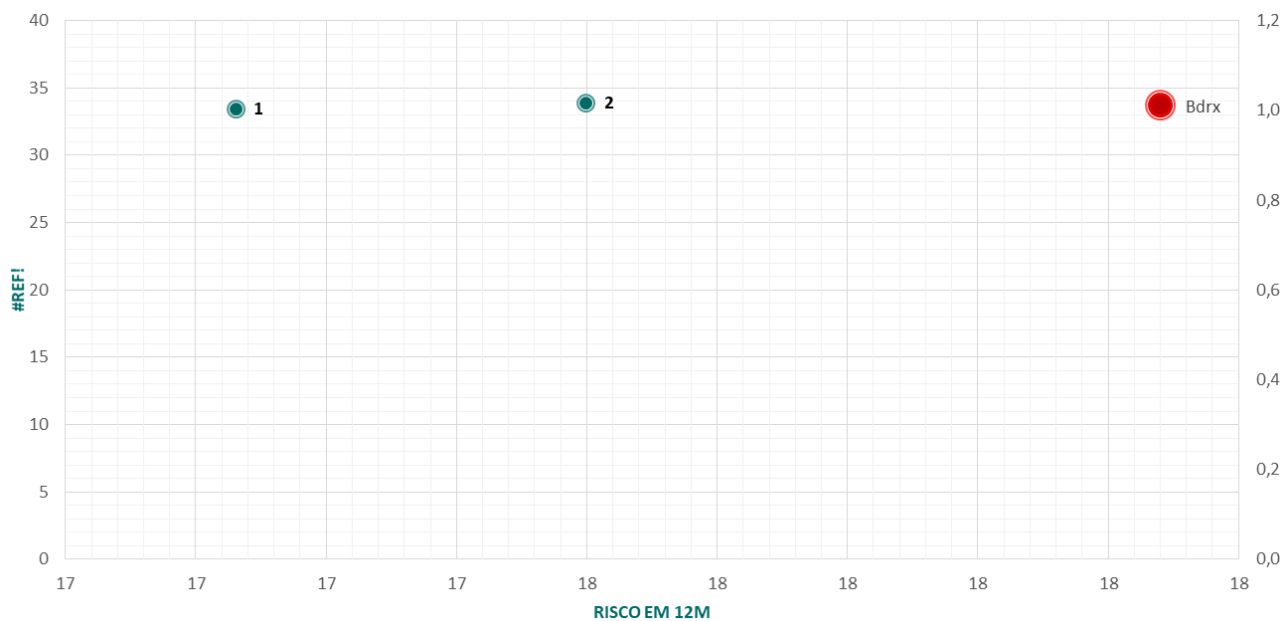


Gráfico 5: Art. 9-A-IIIº Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)



Relatório de Anual Investimentos - 2021

035

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art 9º - A - III - BDR Nível I	BB Acoes Esg FIA - Bdr Nível I	33,49	17,23	D+001	D+004
2	art 9º - A - III - BDR Nível I	Safrá Consumo Americano FIA Bdr Nível I	33,92	17,50	D+001	D+004

Quadro 6. Legenda Gráfico 5.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT3NDU4



PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 15 de fevereiro de 2022, apresenta o Relatório de Anual Investimentos de 2021, com o acompanhamento da Rentabilidade e Risco das diversas modalidades de operações realizadas nas aplicações dos recursos do RPPS.

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

Todas as operações efetuadas, são acompanhadas pelo Controles Internos, e aprovadas pela Diretoria, com base nas Atas de Reunião do Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev.

Manaus – AM, 15 de fevereiro de 2022.

Alan Nascimento
Coordenador

Bruno Costa Novo
Secretário

Bruno Barroso
Membro

Leonardo Cavalcanti
Membro

Wellington Bentes
Membro

Claudinei Soares
Membro

André Luiz Bentes
Membro

Marcos Souza
Membro

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT3NDU4



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

Processo: 2023.A.02478

Destino: DIRAF / PRESI

Assunto: Relatório Anual de Investimentos de 2022

Data: 22/03/2023

RELATÓRIO Nº 016/2023 - COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório Anual de Investimentos referente ao exercício de 2022:

- 1) Resumo do Cenário econômico externo e interno referente ao exercício de 2022 (páginas 03 a 07);
- 2) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Poder Executivo, apresentando os saldos e performance dos Fundos de Investimentos, evolução dos saldos dos Fundos de Investimentos, imóveis e CVS, comparativo da rentabilidade com a Meta Atuarial, Evolução e variação dos recursos do FPREV Executivo (páginas 08 a 14);
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 15 a 17);
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (páginas 18 a 19);
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (páginas 20 a 21);
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (páginas 22 a 24)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (páginas 25 a 26);
- 8) Rentabilidade do Fundo Previdenciário - Consolidado – FPREV (páginas 27 a 28);
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro – (páginas 29 a 30);
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 31);
- 11) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 32 a 37);
- 12) Total dos Recursos e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (página 38);
- 13) Relatório de Riscos da Carteira (páginas 39 a 47);
- 14) Parecer do Comitê de Investimentos (página 48).

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17

Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>

e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

1. RESUMO DO CENÁRIO DO EXERCÍCIO DE 2022

Ao longo de 2022, o mercado financeiro enfrentou situações diversas — algumas positivas e outras negativas. Além disso, muitas circunstâncias antecipam o que poderá acontecer em 2023, então vale a pena conhecê-las para se preparar adequadamente para investir no novo ano.

Inflação e deflação - Ao longo de 2022, um dos principais fenômenos que ocorreram no mercado nacional e no mercado global foi a inflação persistente. Essa situação se caracteriza pelo aumento contínuo e generalizado de preços, levando à perda do poder de compra da população.

Nos Estados Unidos, por exemplo, a inflação atingiu o patamar recorde em 40 anos, quando chegou a 9,1% acumulados em 12 meses, em junho. A Europa e o Brasil, além de outros mercados, sofreram com efeitos semelhantes.

No contexto global, o principal fator para a aceleração da inflação foi a escalada de preços das commodities, devido à guerra entre Rússia e Ucrânia. Por causa do aumento do preço do petróleo e do gás natural, principalmente, o custo de energia ficou mais elevado, impactando as economias.

No Brasil, entretanto, o cenário contrário também ocorreu: a deflação. Ela se concretiza quando em vez do aumento há uma queda generalizada nos preços da economia. Entre julho e setembro, o Brasil registrou três períodos de deflação consecutivos, registrados pelo Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA).

Essa situação ocorreu, principalmente, devido às medidas adotadas pelo Governo Federal, como a redução ou eliminação de impostos sobre os combustíveis. Assim, o IPCA acumulado dos 12 meses se movimentou para baixo, deixando de apresentar dois dígitos.

Taxa Selic: 5 altas consecutivas em 2022 - Quando ocorre um aumento no nível de inflação, é comum que as entidades monetárias dos países tomem medidas para conter o avanço dos preços. No caso do Brasil, a principal estratégia adotada pelo Banco Central (Bacen) é o aumento da taxa Selic.

Essa é a taxa básica de juros da economia brasileira e é definida pelo Comitê de Política Monetária (Copom), em reuniões que ocorrem a cada 45 dias. Na prática, a Selic já vinha de um período de altas em 2021, o que se consolidou ao longo do ano seguinte.

Na primeira reunião do Copom em 2022, ocorrida em fevereiro, a taxa passou de 9,25% para 10,75% ao ano. Nas outras quatro reuniões — em março, maio, junho e agosto — ocorreram novos aumentos, até que a taxa chegasse a 13,75% ao ano.

Esse foi o maior patamar da Selic desde novembro de 2016 e foi alcançado graças a 5 aumentos consecutivos em 2022. No último encontro do Copom no ano, o comitê decidiu manter a taxa em 13,75%, repetindo a decisão das duas reuniões anteriores.



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

No geral, essa estratégia ajudou a controlar a inflação do país e, possivelmente, contribuiu para o cenário de deflação. Contudo, é importante considerar que esse aumento também prejudica a atividade econômica nacional.

Isso acontece porque a Selic é usada como referência para todas as outras taxas do mercado. Com o aumento da Selic, a tendência é que as demais taxas fiquem maiores, o que eleva o custo de crédito e desestimula o consumo.

Aumento dos juros pelo mundo - Como a inflação não afetou apenas o Brasil, outros países também realizaram aumentos em suas taxas de juros. Os crescimentos mais significativos e impactantes ocorreram nos Estados Unidos.

No país, o Federal Open Market Committee (FOMC) é um comitê subordinado ao Federal Reserve (Fed) e realiza alterações na taxa de juros (interest rate) do país. Ao longo de 2022, o Fed fez 5 aumentos consecutivos na taxa de juros americana. Com isso, ela passou a estar na faixa de 4,25% a 4,5%, lembrando que o intervalo de juros no início de 2022 era de 0,00% a 0,25%..

Essa situação pode causar impactos em todo o cenário global, já que o aumento tão significativo das taxas pode afetar o desempenho da economia norte-americana — uma das maiores e mais relevantes do mundo.

Além dos EUA, outros mercados realizaram uma alteração semelhante. O Banco Central Europeu (BCE), por exemplo, aumentou a taxa de juros da Zona do Euro para 2,5%, com o objetivo de diminuir a inflação. Já na Inglaterra, a taxa subiu para 3,5% ao ano, sendo o maior valor alcançado nos últimos 14 anos.

A volta da renda fixa – Diante desse cenário de alta de juros pelo mundo, a taxa de juros brasileira aumentou em 2022. No cenário brasileiro, especificamente, esse aumento interfere nas escolhas dos investidores.

A renda fixa é especialmente impactada por esse aumento, já que títulos prefixados, pós-fixados e híbridos dependem, direta ou indiretamente, do comportamento da Selic. Desse modo, o aumento dos juros brasileiros tende a fazer com que as aplicações financeiras dessa classe se tornem mais interessantes.

Isso acontece, principalmente, porque os investidores têm a chance de obter rendimentos maiores com títulos dessa classe, mas sem correr riscos tão elevados. Em comparação à renda variável, por exemplo, pode ser mais vantajoso focar na renda fixa quando a Selic está em alta.

É por isso que, no segundo trimestre de 2022, a renda fixa representava mais de 60% dos investimentos dos brasileiros. O número caracteriza o maior patamar trimestral desde 2018, segundo a Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e de Capitais (ANBIMA).

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjKzNjE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

Esse cenário se contrapõe ao que ocorreu em 2020. Naquele ano, a Selic atingiu sua mínima histórica, chegando a 2% ao ano. Como consequência, o investimento em renda fixa se tornou pouco atraente, devido ao baixo potencial de retorno.

Com a elevação da Selic, portanto, é possível falar em uma volta da renda fixa. Afinal, essa classe de investimentos passou a despertar mais interesse diante das condições do cenário em 2022.

Desempenho do Ibovespa no ano de 2022 - Logo no começo de 2022, o Ibovespa — principal índice de ações brasileiro — apresentava uma tendência de alta. Somente em janeiro, o índice teve uma valorização de 7% no mês. No entanto, esse resultado passou a ser revertido ainda no primeiro semestre, quando ocorreram diversas quedas no desempenho da bolsa brasileira.

Um dos motivos para essa situação foi a guerra entre Rússia e Ucrânia. Com a disputa no Leste Europeu, houve um aumento no preço das commodities e uma percepção mais elevada a respeito do risco global. Logo, houve uma saída de investidores estrangeiros, favorecendo a queda da bolsa.

Outras questões também ajudam a explicar esse comportamento do Ibovespa. Um dos aspectos se relaciona ao aumento da Selic. Quando isso ocorre, tende a haver uma queda no consumo, o que pode prejudicar o desempenho de empresas e, consequentemente, do índice Bovespa.

O aumento da taxa de juros nos EUA é mais uma situação que ajuda a justificar a queda da bolsa brasileira. Isso ocorre, principalmente, porque os títulos do Tesouro americano são considerados os investimentos mais seguros do mundo.

Com o aumento dos juros, eles passam a render mais e se tornam mais atraentes. Em um cenário de maior cautela dos investidores, é comum haver a saída deles de mercados emergentes — como o Brasil — em busca do investimento em títulos mais seguros e que passam a ter maior retorno.

Ainda, vale considerar a realização das eleições gerais em outubro e a percepção de risco fiscal, relacionado à condução da política econômica. Afinal, esses fatores contribuíram, de certa maneira, para o movimento da bolsa brasileira no segundo semestre de 2022.

Valorização e queda do dólar - Outro aspecto importante para considerar sobre o mercado financeiro em 2022 envolve o comportamento do dólar — e não apenas a sua relação com o real.

No caso do cenário nacional, o dólar chegou a ser negociado por R\$ 5,50, em 24 de janeiro. Em julho, diante da volatilidade maior no mercado financeiro, ele voltou a subir e chegou a R\$ 5,46, tendo a maior alta em 6 meses.

Para entender a volatilidade do câmbio e do mercado, em geral, basta notar que o dólar também atingiu seu menor valor em 2 anos ao longo de 2022. Foi em abril que a moeda norte-americana chegou a ser negociada a R\$ 4,66.



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

No Brasil, alguns motivos ajudam a justificar o comportamento do dólar, como a saída de investidores internacionais da bolsa brasileira. Também tem peso o contexto de inflação elevada, já que o cenário pode indicar uma deterioração econômica, aumentando a aversão ao risco dos investidores.

Ainda, vale notar que, em 2022, outros países sofreram com a força do dólar. Em julho, por exemplo, o dólar e o euro passaram a valer o mesmo, pela primeira vez em 20 anos. A libra esterlina também atingiu uma baixa histórica em relação ao dólar, quase alcançando a paridade com a moeda norte-americana.

Isso se deve a dois motivos principais. O primeiro aspecto é o fato de o dólar ser considerado uma reserva de valor, então ele é buscado por investidores diante de situações de crises e maior percepção de risco. Em 2022, portanto, mais pessoas investiram em dólar e o fortaleceram.

Ademais, essa é a principal moeda usada nos contratos comerciais internacionais. Com isso, o dólar tem mais liquidez que outras moedas, o que pode valorizá-lo no mercado.

Economia brasileira mostra recuperação em 2022 - Em 2021, o crescimento do Produto Interno Bruto (PIB) brasileiro foi de 4,6%, retornando aos patamares pré-pandemia. No primeiro semestre de 2022, as expectativas de crescimento do PIB eram de 1,1%, no caso do Instituto de Pesquisa Econômica Aplicada (Ipea).

Contudo, a economia brasileira deu alguns sinais de recuperação ao longo do ano, mesmo com a atuação para conter a inflação do período. No primeiro trimestre de 2022, por exemplo, o PIB do Brasil aumentou 1,2%.

Com isso, ocorreram diversas revisões sobre as expectativas de crescimento brasileiro. Conforme dados do Ipea, a previsão de aumento do PIB passou para 3,1% no começo de dezembro.

Embora isso não signifique que o resultado se repetirá em 2023 — devido às condições e expectativas do mercado financeiro —, o desempenho econômico em 2022 está alinhado a um cenário de recuperação.

Impactos da economia global - Como você viu até aqui, os efeitos no mercado financeiro não foram sentidos apenas no Brasil. Com os impactos subsequentes da pandemia de covid-19 e da guerra ucraniana, toda a economia global sentiu as consequências dos acontecimentos ao longo do ano.

Segundo o Fundo Monetário Internacional (FMI), por exemplo, a expectativa é que o crescimento da economia global passasse de 6%, em 2021, para 3,2% em 2022.

No geral, os desafios concretizados em 2022 contribuíram para uma desaceleração do cenário global. Porém, nem todos os países sentiram os impactos da mesma forma.



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

Os países desenvolvidos, como EUA e integrantes da União Europeia, foram mais afetados ao longo do ano pela pressão dos preços das commodities e pela inflação que ainda não havia sido controlada.

No caso de mercados emergentes, como o Brasil, o ciclo de alta na taxa de juros já vinha acontecendo desde 2021. Assim, quem começa a aumentar as taxas antes tende a se recuperar mais cedo do que os países que demoram mais para elevar os juros.

Além disso, em toda a economia global, foi possível perceber um aumento do grau de volatilidade e de incerteza financeira. Como referência, é possível observar o S&P 500, um índice composto pelas ações das 500 empresas mais significativas e mais negociadas dos Estados Unidos.

Por sua magnitude, o indicador é representativo do mercado acionário americano. Em 2022, o indicador acumulava queda de 20% no primeiro semestre, por exemplo. Em cenários como esse, a economia global tende a ser afetada devido ao grau de instabilidade.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjKzNjE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

2.1. SALDOS E PERFORMANCE RENDA FIXA

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	31/12/2021	30/12/2022	RENTABILIDADE
			2022
BB PREVID TP VII	R\$ 7.120.337,67	R\$ 7.885.247,87	13,9763%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 53.538.599,32	R\$ 55.189.263,72	8,7100%
SAFRA SOBERANO REGIM PROP DI	R\$ -	R\$ 78.858.235,25	8,8120%
BB PREVID IDKA 2	R\$ 300.635.822,30	R\$ -	0,0000%
BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 271.047.525,22	R\$ -	0,0000%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 492.367.703,98	R\$ -	0,0000%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 373.319.988,18	R\$ -	0,0000%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 133.951.797,73	R\$ -	0,0000%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 93.399.609,36	R\$ -	0,0000%
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 29.159.159,12	R\$ -	0,0000%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 22.029,78	R\$ -	0,0000%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 1.754.562.572,66	R\$ 141.932.746,84	
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 75.287,33	R\$ 17.288,85	11,7918%
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 27.544.534,01	R\$ 211.823.869,28	13,0000%
CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP	R\$ -	R\$ 92.331.233,75	9,8632%
ICATU VANGUARDIA FIRF PLUS LP	R\$ 112.387.683,11	R\$ 109.587.609,85	8,8333%
ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ -	R\$ 3.542.275,02	8,7690%
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 140.007.504,45	R\$ 417.302.276,75	
CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE	R\$ -	R\$ 150.000.000,00	NC
TOTAL art. 7º, inciso IV	R\$ -	R\$ 150.000.000,00	
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 107.652.513,38	R\$ 120.910.991,78	13,4878%
ITAU HIGH GRADE RF DP FIC FI	R\$ 61.624.409,75	R\$ 147.168.816,77	13,4600%
BTG PACTUAL CRED CORP FIC FI RF CP	R\$ 34.855.852,12	R\$ 98.780.559,63	14,2400%
MAG CRED PRIV FI RF LP	R\$ 34.040.408,86	R\$ 62.490.499,08	13,6100%
PORTO SEGURO FI REFER DI CRED PRIV	R\$ -	R\$ 146.779.351,67	12,2644%
BNP PARIBAS MATCH DI FI RF REF CP	R\$ -	R\$ 72.803.692,52	8,0287%
RIO BRAVO CREDITO PRIVADO FI RF	R\$ -	R\$ 12.431.340,24	7,1648%
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 238.173.184,11	R\$ 661.365.251,69	

Quadro 1.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

2.2 SALDOS E PERFORMANCE RENDA VARIÁVEL

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	31/12/2021	30/12/2022	RENTABILIDADE
			2022
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 38.807.964,00	R\$ 66.723.073,47	-2,0000%
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 76.459.160,97	R\$ 70.345.239,26	-8,0000%
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 101.786.211,51	R\$ 98.253.934,42	-3,4702%
BB AÇÕES SELEÇÃO FATOR FIC FI	R\$ 50.145.820,90	R\$ 49.767.266,24	-0,7549%
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 152.999.296,21	R\$ 112.267.636,26	-8,2500%
BRASIL CAPITAL RP INSTIT FIC AÇÕES	R\$ 41.113.518,85	R\$ 38.252.758,52	-6,9600%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 227.851.827,32	R\$ 184.740.124,14	-4,6700%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANT	R\$ 11.997.742,88	R\$ 12.294.469,00	2,4732%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 17.242.753,11	R\$ 18.352.468,46	6,4358%
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 76.750.860,53	R\$ 80.846.135,32	5,3400%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 157.617.379,80	R\$ 93.874.541,89	5,1600%
ITAU SMALL CAPS VALUATION	R\$ 104.186.789,94	R\$ 69.154.719,11	-9,4500%
OCCAM FIC FIA	R\$ 80.861.753,24	R\$ 110.084.085,82	4,5200%
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 97.670.543,70	R\$ 93.214.497,15	-4,5600%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 22.605.221,39	R\$ 59.515.970,30	10,4589%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 35.164.933,77	R\$ 35.227.121,75	0,1800%
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ -	R\$ 41.422.147,59	12,4916%
TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ -	R\$ 4.750.832,68	16,3643%
TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ -	R\$ 60.100.090,58	13,2852%
4UM SMALL CAPS FIA	R\$ -	R\$ 39.787.362,84	-11,8400%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	R\$ -	R\$ 4.182.085,85	-4,3328%
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ -	R\$ 40.039.781,67	-1,7593%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ -	R\$ 14.109.109,63	-6,0569%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 34.095.419,66	R\$ -	0,0000%
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 26.804.565,85	R\$ -	0,0000%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 8.130.314,94	R\$ -	0,0000%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FI AÇÕES	R\$ 7.941.806,13	R\$ -	0,0000%
SANTANDER CRESC SENIOR (TOP AÇÕES)	R\$ 12.327,77	R\$ -	0,0000%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 1.370.246.212,47	R\$ 1.397.305.451,95	

Quadro 2.

2.3 SALDOS E PERFORMANCE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	31/12/2021	30/12/2022	RENTABILIDADE
			2022
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 25.980.390,21	R\$ 20.979.443,86	-19,2489%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 41.389.565,28	R\$ 32.447.139,23	-21,3112%
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 34.417.308,95	R\$ 12.838.980,43	-62,3475%
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 154.235.894,63	R\$ 44.790.174,49	-25,7865%
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 32.233.514,06	R\$ 25.059.710,90	-22,4700%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	288.256.673,13	136.115.448,91	
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	R\$ 168.086.619,73	R\$ 56.680.008,07	-25,1474%
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 163.286.774,60	R\$ 42.866.060,36	-30,3900%
ITAU BDR NÍVEL I AÇÕES FIC	R\$ -	R\$ 35.734.854,74	-11,7278%
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 331.373.394,33	R\$ 135.280.923,17	

Quadro 3.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

2.4 SALDOS E PERFORMANCE – FUNDOS ESTRUTURADOS

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	31/12/2021	30/12/2022	RENTABILIDADE
			2022
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 23.614.189,43	R\$ 29.040.957,02	-8,0003%
FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV FIM	R\$ -	R\$ 15.383.696,84	2,8529%
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ -	R\$ 17.081.845,43	0,7602%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MM	R\$ -	R\$ 15.325.287,61	2,3500%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$ -	R\$ 30.085.990,02	1,1883%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MM	R\$ -	R\$ 10.287.728,13	2,9700%
ITAÚ MM SP500 BRL FIC	R\$ 109.658.401,60	R\$ -	0,0000%
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 28.619.821,87	R\$ -	0,0000%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 161.892.412,90	R\$ 117.205.505,05	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 13.828.108,17	R\$ 35.218.329,99	57,8100%
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.256.195,85	R\$ 19.233.118,99	5,8000%
CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$ -	R\$ 1.112.237,95	29,0005%
KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$ -	R\$ 15.993.362,43	-13,4686%
TOTAL art. 10º, inciso II	R\$ 23.084.304,02	R\$ 71.557.049,36	
TOTAL GERAL	R\$ 4.307.596.258,07	R\$ 3.228.064.653,72	

Quadro 4.

2.5 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

INSTITUIÇÃO	31/12/2021		INSTITUIÇÃO	31/12/2022	
	VALOR (R\$)	(%)		VALOR (R\$)	(%)
BRDESCO	R\$ 180.488.283,21	4,19%	BRDESCO	R\$ 474.108.794,39	14,69%
BTG	R\$ 293.778.064,80	6,82%	BTG	R\$ 367.013.089,77	11,37%
ITAÚ	R\$ 467.374.194,00	10,85%	ITAÚ	R\$ 349.475.207,53	10,83%
BANCO DO BRASIL	R\$ 924.840.916,61	21,47%	BANCO DO BRASIL	R\$ 233.565.900,46	7,24%
CAIXA	R\$ 954.994.090,41	22,17%	CAIXA	R\$ 192.280.508,74	5,96%
ICATU	R\$ 311.869.969,08	7,24%	ICATU	R\$ 190.433.745,17	5,90%
SANTANDER	R\$ 261.901.852,49	6,08%	SANTANDER	R\$ 165.701.166,27	5,13%
PORTO	R\$ -		PORTO	R\$ 146.779.351,67	4,55%
VINCI	R\$ 132.673.964,75	3,08%	VINCI	R\$ 129.553.856,85	4,01%
SAFRA	R\$ 325.654.277,11	7,56%	SAFRA	R\$ 121.724.295,61	3,77%
OCCAM	R\$ 80.982.809,65	1,88%	OCCAM	R\$ 110.084.085,82	3,41%
BNP	R\$ 8.184.432,89	0,19%	BNP	R\$ 72.803.692,52	2,26%
AZ QUEST	R\$ 76.244.453,77	1,77%	AZ QUEST	R\$ 70.345.239,26	2,18%
RIO BRAVO	R\$ -		RIO BRAVO	R\$ 68.130.346,00	2,11%
ARX	R\$ 38.768.366,32	0,90%	ARX	R\$ 66.723.073,47	2,07%
MONGERAL	R\$ 34.030.010,44	0,79%	MONGERAL	R\$ 62.490.499,08	1,94%
TARPON	R\$ -		TARPON	R\$ 60.100.090,58	1,86%
GUEPARDO	R\$ 22.399.500,54	0,52%	GUEPARDO	R\$ 59.515.970,30	1,84%
TRÍGONO	R\$ -		TRÍGONO	R\$ 46.172.980,27	1,43%
PLURAL	R\$ 75.813.694,14	1,76%	PLURAL	R\$ 45.286.119,66	1,40%
4UM	R\$ -		4UM	R\$ 43.969.448,69	1,36%
CONSTANCIA	R\$ -		CONSTANCIA	R\$ 40.039.781,67	1,24%
BRASIL CAPITAL	R\$ 40.922.164,45	0,95%	BRASIL CAPITAL	R\$ 38.252.758,52	1,19%
SCHRODER	R\$ 32.306.971,94	0,75%	SCHRODER	R\$ 25.059.710,90	0,78%
DAYCOVAL	R\$ 17.230.385,03	0,40%	DAYCOVAL	R\$ 18.352.468,46	0,57%
INTRAG	R\$ -		INTRAG	R\$ 15.993.362,43	0,50%
SULAMÉRICA	R\$ 26.707.096,80	0,62%	SULAMÉRICA	R\$ -	0,00%
CLARITAS	R\$ -		CLARITAS	R\$ 14.109.109,63	0,44%
TOTAL GERAL	R\$ 4.307.165.498,44		TOTAL GERAL	R\$ 3.228.064.653,72	

Quadro 5.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

2.6 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS

TPF (COMPRA - VENCIMENTO)	SALDO		RENTABILIDADE
	31/12/2021	30/12/2022	2022
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 188.399.793,46	R\$ 190.562.337,87	12,64%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 197.123.206,88	R\$ 199.404.567,22	12,77%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 204.008.660,73	R\$ 206.418.076,41	13,08%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 204.991.658,07	R\$ 207.364.114,55	12,77%
NTN-B (02/02/2022 - 15/05/23)	R\$ -	R\$ 52.544.809,48	11,38%
NTN-B (09/02/2022 - 15/05/23)	R\$ -	R\$ 52.380.913,16	11,03%
NTN-B (22/02/2022 - 15/05/23)	R\$ -	R\$ 104.269.504,40	10,50%
NTN-B (23/02/2022 - 15/05/23)	R\$ -	R\$ 104.209.906,84	10,44%
NTN-B (24/02/2022 - 15/05/23)	R\$ -	R\$ 104.206.047,61	10,43%
NTN-B (25/02/2022 - 15/05/23)	R\$ -	R\$ 104.054.440,10	10,27%
NTN-B (07/03/2022 - 15/05/23)	R\$ -	R\$ 51.558.403,89	9,31%
NTN-B (08/03/2022 - 15/05/23)	R\$ -	R\$ 103.062.324,76	9,25%
NTN-B (17/03/2022 - 15/05/23)	R\$ -	R\$ 51.164.002,79	8,46%
NTN-B (26/05/2022 - 15/08/2024)	R\$ -	R\$ 33.648.565,17	4,28%
NTN-B (26/05/2022 - 15/05/2025)	R\$ -	R\$ 33.630.642,70	4,89%
NTN-B (26/05/2022 - 15/08/2032)	R\$ -	R\$ 33.445.898,26	4,86%
NTN-B (27/05/2022 - 15/08/2024)	R\$ -	R\$ 101.894.381,73	4,92%
NTN-B (30/05/2022 - 15/08/2024)	R\$ -	R\$ 101.885.973,68	4,89%
NTN-B (31/05/2022 - 15/08/2024)	R\$ -	R\$ 101.999.574,72	5,01%
NTN-B (31/05/2022 - 15/08/2024)	R\$ -	R\$ 61.685.621,82	5,02%
NTN B (07/07/2022 - 15/05/2035)	R\$ -	R\$ 50.250.486,19	3,45%
NTN B (07/07/2022 - 15/08/2040)	R\$ -	R\$ 50.237.592,31	1,42%
NTN B (18/11/2022 - 15/08/2024)	R\$ -	R\$ 101.861.879,36	1,86%
NTN B (24/11/2022 - 15/08/2024)	R\$ -	R\$ 101.836.811,05	1,84%
NTN B (24/11/2022 - 15/08/2028)	R\$ -	R\$ 45.775.424,95	1,73%
NTN B (24/11/2022 - 15/08/2032)	R\$ -	R\$ 45.775.189,85	1,73%
LTN (24/11/2022 - 01/01/2025)	R\$ -	R\$ 10.136.466,92	1,31%
NTN - B (15/12/2022 - 15/08/2032)	R\$ -	R\$ 30.258.796,76	0,81%
NTN - B (20/12/2022 - 15/08/2026)	R\$ -	R\$ 44.141.595,65	0,79%
TOTAL GERAL	R\$ 794.523.319,15	R\$ 2.479.664.350,20	

Quadro 6.

Nota 1: Títulos Públicos atualizados pelo valor de aquisição acrescido da taxa de juros. (Ver quadro 7).

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

2.7 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

DATA DA LIQUIDAÇÃO	ORIGEM DO RECURSO / ÓRGÃO	VENCIMENTO	VALOR NA COMPRA	TAXA %	INSTITUIÇÃO CEDENTE
14/01/2014	EXECUTIVO	15/05/2023	R\$ 99.765.417,74	6,4800%	BANCO BRADESCO
14/01/2014	EXECUTIVO	15/08/2030	R\$ 99.437.031,23	6,5998%	BANCO BRADESCO
28/01/2014	EXECUTIVO	15/08/2030	R\$ 98.620.663,31	6,9000%	BANCO BRADESCO
14/01/2014	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 99.980.152,45	6,6000%	BANCO BRADESCO
29/01/2014	ASSEMBLEIA	15/08/2030	R\$ 1.357.103,79	6,5998%	BANCO BRADESCO
02/02/2022	EXECUTIVO	15/05/2023	R\$ 50.001.368,89	6,5300%	BANCO DO BRASIL
09/02/2022	EXECUTIVO	15/05/2023	R\$ 50.003.301,13	6,3930%	BTG PACTUAL CTVM
11/02/2022	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2023	R\$ 39.974.516,15	6,5450%	BTG PACTUAL CTVM
22/02/2022	EXECUTIVO	15/05/2023	R\$ 99.996.472,56	6,4120%	BTG PACTUAL CTVM
23/02/2022	EXECUTIVO	15/05/2023	R\$ 99.996.737,59	6,4200%	BANCO BRADESCO
24/02/2022	EXECUTIVO	15/05/2023	R\$ 99.999.092,10	6,4700%	BANCO BRADESCO
25/02/2022	EXECUTIVO	15/05/2023	R\$ 99.999.165,21	6,3450%	XP INVESTIMENTOS CCTVM
07/03/2022	EXECUTIVO	15/05/2023	R\$ 49.999.855,96	6,3250%	XP INVESTIMENTOS CCTVM
08/03/2022	EXECUTIVO	15/05/2023	R\$ 99.997.284,19	6,3550%	BTG PACTUAL CTVM
17/03/2022	EXECUTIVO	15/05/2023	R\$ 49.997.851,75	6,0820%	XP INVESTIMENTOS CCTVM
26/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 32.996.277,05	5,9080%	BTG PACTUAL CTVM
26/05/2022	EXECUTIVO	15/05/2025	R\$ 32.996.442,13	5,7700%	ITAU UNIBANCO S/A
26/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2032	R\$ 32.999.881,95	5,7600%	ITAU UNIBANCO S/A
27/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 99.996.790,45	5,8400%	XP INVESTIMENTOS CCTVM
30/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 99.996.581,53	5,8300%	XP INVESTIMENTOS CCTVM
31/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 99.996.708,44	6,0200%	BRADESCO
31/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 60.469.094,79	6,0350%	XP INVESTIMENTOS CCTVM
09/06/2022	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/08/2024	R\$ 49.999.161,74	5,8090%	SANTANDER
15/06/2022	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2023	R\$ 199.999.428,21	6,7400%	XP INVESTIMENTOS CCTVM
07/07/2022	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 49.997.001,46	6,0348%	XP INVESTIMENTOS CCTVM
07/07/2022	EXECUTIVO	15/05/2035	R\$ 49.997.851,49	6,0300%	BANCO BRADESCO
12/07/2022	ASSEMBLEIA	15/05/2035	R\$ 5.499.958,54	6,2700%	BTG PACTUAL CTVM
12/07/2022	TRIBUNAL DE CONTAS	15/05/2035	R\$ 16.999.871,84	6,2700%	BTG PACTUAL CTVM
12/07/2022	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2035	R\$ 47.499.641,91	6,2700%	BTG PACTUAL CTVM
12/07/2022	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/05/2035	R\$ 19.999.849,23	6,2700%	BTG PACTUAL CTVM
12/07/2022	DEFENSORIA PÚBLICA	15/05/2035	R\$ 9.999.924,61	6,2700%	BTG PACTUAL CTVM
18/11/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 99.997.037,06	6,7000%	XP INVESTIMENTOS CCTVM
24/11/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 99.998.464,79	7,0100%	XP INVESTIMENTOS CCTVM
24/11/2022	EXECUTIVO	15/08/2028	R\$ 44.998.285,53	6,3100%	BGC LIQUIDEZ
24/11/2022	EXECUTIVO	15/08/2032	R\$ 44.998.054,42	6,3100%	BGC LIQUIDEZ
24/11/2022	EXECUTIVO - LTN	01/01/2025	R\$ 10.005.811,97	14,0800%	BGC LIQUIDEZ
13/12/2022	DEFENSORIA PÚBLICA	15/05/2025	R\$ 35.000.000,00	6,3925%	XP INVESTIMENTOS CCTVM
13/12/2022	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/05/2025	R\$ 12.000.000,00	6,3925%	XP INVESTIMENTOS CCTVM
13/12/2022	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2025	R\$ 2.998.480,93	6,3925%	XP INVESTIMENTOS CCTVM
13/12/2022	TRIBUNAL DE CONTAS	15/05/2027	R\$ 10.000.000,00	6,3100%	BGC LIQUIDEZ
13/12/2022	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2027	R\$ 40.001.143,66	6,3100%	BGC LIQUIDEZ
15/12/2022	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/08/2024	R\$ 49.998.121,72	6,9500%	XP INVESTIMENTOS CCTVM
15/12/2022	TRIBUNAL DE CONTAS	15/08/2024	R\$ 49.998.121,72	6,9500%	XP INVESTIMENTOS CCTVM
15/12/2022	EXECUTIVO	15/08/2032	R\$ 30.000.634,84	6,4350%	BGC LIQUIDEZ
15/12/2022	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/08/2028	R\$ 19.997.391,52	6,4600%	BGC LIQUIDEZ
20/12/2022	ASSEMBLEIA	15/08/2026	R\$ 1.199.255,73	6,5830%	XP INVESTIMENTOS CCTVM
20/12/2022	EXECUTIVO	15/08/2026	R\$ 43.796.819,33	6,5830%	XP INVESTIMENTOS CCTVM
TOTAL			R\$ 2.793.555.301,78		

Quadro 7.

2.8 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	31/12/2021	30/12/2022
CVS - A	R\$ 1.048.518,02	R\$ 852.575,04
CVS - B	R\$ 6.783.585,05	R\$ 5.515.672,25
CVS - C	R\$ 136.015,88	R\$ 110.597,76
CVS - D	R\$ 743.910,42	R\$ 604.866,90
TOTAL	R\$ 8.712.029,37	R\$ 7.083.711,95

Quadro 8.

Nota: Os Títulos CVS realizam amortização mensal dos Juros e antecipação de parte do Principal (quadro a seguir), justificando a redução mensal dos valores em carteira.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjKzNjE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

2.9 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/22	R\$ 25.234,67	R\$ 145.243,31	R\$ 170.477,98
fev/22	R\$ 24.814,21	R\$ 145.243,31	R\$ 170.057,52
mar/22	R\$ 24.417,20	R\$ 145.386,05	R\$ 169.803,25
abr/22	R\$ 24.009,52	R\$ 145.386,05	R\$ 169.395,57
mai/22	R\$ 23.627,78	R\$ 145.687,38	R\$ 169.315,16
jun/22	R\$ 23.240,46	R\$ 145.830,12	R\$ 169.070,58
jul/22	R\$ 22.855,32	R\$ 146.115,60	R\$ 168.970,92
ago/22	R\$ 22.486,35	R\$ 146.416,93	R\$ 168.903,28
set/22	R\$ 22.102,11	R\$ 146.718,26	R\$ 168.820,37
out/22	R\$ 21.709,62	R\$ 147.003,74	R\$ 168.713,36
nov/22	R\$ 21.315,99	R\$ 147.162,33	R\$ 168.478,32
dez/22	R\$ 20.932,96	R\$ 147.447,81	R\$ 168.380,77
TOTAL	R\$ 276.746,19	R\$ 1.753.640,89	R\$ 2.030.387,08

Quadro 9.

2.10 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2022			
MÊS	UEA	SEAS	TOTAL
jan/22	R\$ -	R\$ -	R\$ -
fev/22	R\$ -	R\$ 100.364,40	R\$ 100.364,40
mar/22	R\$ 43.635,72	R\$ -	R\$ 43.635,72
abr/22	R\$ 43.635,72	R\$ 100.364,40	R\$ 144.000,12
mai/22	R\$ -	R\$ -	R\$ -
jun/22	R\$ -	R\$ 445.093,39	R\$ 445.093,39
jul/22	R\$ 87.271,44	R\$ 100.364,40	R\$ 187.635,84
ago/22	R\$ 87.271,44	R\$ -	R\$ 87.271,44
set/22	R\$ -	R\$ 100.364,40	R\$ 100.364,40
out/22	R\$ 43.635,72	R\$ 100.364,40	R\$ 144.000,12
nov/22	R\$ -	R\$ 100.364,40	R\$ 100.364,40
dez/22	R\$ 87.271,44	R\$ 100.364,40	R\$ 187.635,84
TOTAL	R\$ 392.721,48	R\$ 1.147.644,19	R\$ 1.540.365,67

Quadro 10.

2.11 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO			
	31/12/2021	% dos Recursos	30/12/2022	% dos Recursos
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.307.596.258,07	83,8851%	R\$ 3.228.064.653,72	55,8460%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 750.338.872,95	14,6119%	R\$ 2.479.664.350,20	42,8986%
TÍTULOS CVS	R\$ 8.712.029,37	0,1697%	R\$ 7.083.711,95	0,1225%
IMÓVEIS	R\$ 68.293.435,00	1,3299%	R\$ 65.484.778,63	1,1329%
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	0,0000%	R\$ -	0,0000%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 174.185,24	0,0034%	R\$ -	0,0000%
TOTAL	R\$ 5.135.114.780,63	100,00%	R\$ 5.780.297.494,50	100,00%

Quadro 11.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

2.12 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
dez/21	R\$ 5.138.934.502,37	3,21%	6,88%	6,88%
jan/22	R\$ 5.127.420.463,18	-0,22%	-0,22%	9,29%
fev/22	R\$ 5.183.580.609,21	1,10%	0,87%	11,36%
mar/22	R\$ 5.320.489.330,31	2,64%	3,53%	11,68%
abr/22	R\$ 5.227.351.195,97	-1,75%	1,72%	7,37%
mai/22	R\$ 5.288.544.931,25	1,17%	2,91%	6,07%
jun/22	R\$ 5.200.480.011,20	-1,67%	1,20%	3,00%
jul/22	R\$ 5.345.100.326,41	2,78%	4,01%	5,73%
ago/22	R\$ 5.480.240.218,85	2,53%	6,64%	8,98%
set/22	R\$ 5.511.466.216,21	0,57%	7,25%	10,53%
out/22	R\$ 5.705.500.023,14	3,52%	11,02%	15,76%
nov/22	R\$ 5.675.963.312,47	-0,52%	10,45%	14,00%
dez/22	R\$ 5.780.297.494,50	1,84%	12,48%	12,48%

Quadro 12.

2.13 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

1. Investimentos - Executivo

Saldo dos Investimentos em 12/2021			R\$ 5.135.114.780,63
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2022	R\$ 15.009.670,47	R\$ 10.463.470,04	R\$ 4.546.200,43
02/2022	R\$ 46.741.255,69	R\$ 13.383.817,50	R\$ 33.357.438,19
03/2022	R\$ 46.961.000,94	R\$ 11.439.707,28	R\$ 35.521.293,66
04/2022	R\$ 45.229.260,90	R\$ 10.946.668,23	R\$ 34.282.592,67
05/2022	R\$ 46.172.988,27	R\$ 15.327.214,72	R\$ 30.845.773,55
06/2022	R\$ 47.103.866,59	R\$ 10.942.355,40	R\$ 36.161.511,19
07/2022	R\$ 47.549.359,29	R\$ 10.900.524,10	R\$ 36.648.835,19
08/2022	R\$ 48.163.488,37	R\$ 12.302.988,95	R\$ 35.860.499,42
09/2022	R\$ 48.483.431,53	R\$ 10.781.769,44	R\$ 37.701.662,09
10/2022	R\$ 47.905.531,55	R\$ 10.820.436,66	R\$ 37.085.094,89
11/2022	R\$ 47.465.381,12	R\$ 11.535.636,72	R\$ 35.929.744,40
12/2022	R\$ 110.680.756,99	R\$ 16.540.401,56	R\$ 94.140.355,43
Saldo dos Investimentos em 12/2022			R\$ 5.780.297.494,50

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

Taxa de Juros Anual	4,9500 %		Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês	
IPCA (IBGE)	5,7848 %	5,7848 %	0,6200 %	
Juros	4,9500 %	4,9500 %	0,4034 %	
Meta	11,0212 %	11,0212 %	1,0259 %	
Rentabilidade em %	3,6453 %	3,6453 %	0,1796 %	
Rentabilidade em R\$	R\$ 193.101.712,76	R\$ 193.101.712,76	R\$ 10.193.826,57	
Resultado em %	-6,6437 %	-6,6437 %	-0,8377 %	
Resultado em R\$	R\$ -390.463.983,92	R\$ -390.463.983,92	R\$ -48.037.489,35	

Quadro 13.

Nota 1: Os valores de **Receita** referem-se às contribuições previdenciárias recebidas no período. Os valores de **Despesas** referem-se ao pagamento de inativos e pensionistas do Executivo FPREV, registrados sob Regime de Caixa.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B. NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjKzNjE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	SALDOS		RENTABILIDADE
	31/12/2021	30/12/2022	2022
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 91.089,75	R\$ 98.145,85	7,830%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 91.089,75	R\$ 98.145,85	
ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LP	R\$ 75.497,45	R\$ 83.118,81	8,833%
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ -	R\$ 259.573,77	0,000%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 5.181.412,73	R\$ -	0,000%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 75.590,14	R\$ -	0,000%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 364.732,60	R\$ -	0,000%
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 5.697.232,92	R\$ 342.692,58	
CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE	R\$ -	R\$ 540.275,98	-
TOTAL art. 7º, inciso IV	R\$ -	R\$ 540.275,98	
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 2.036.309,03	R\$ 2.259.367,15	10,95%
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 165.527,34	R\$ 1.048.013,22	14,23%
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 2.201.836,37	R\$ 3.307.380,37	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 441.840,95	R\$ 465.416,71	5,340%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 1.097.665,91	R\$ 1.046.358,30	-4,670%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT	R\$ 478.650,33	R\$ 490.488,23	2,473%
OCCAM FIC FIA	R\$ 1.869.922,31	R\$ 1.954.450,52	4,520%
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 109.838,06	R\$ 102.195,31	-6,960%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 3.997.917,56	R\$ 4.058.909,07	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 1.699.304,75	R\$ 1.182.855,33	-30,39%
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 1.699.304,75	R\$ 1.182.855,33	
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 786.452,84	R\$ 692.705,53	-11,920%
ITAÚ MM SP500 BRL FIC	R\$ 170.527,33	R\$ 150.198,45	-11,920%
BTG PACTUAL S&P500 BRL FI MULTIMERCADO	R\$ -	R\$ 329.313,96	-0,849%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 956.980,17	R\$ 1.172.217,94	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 50.882,03	
VALORES EM TRANSITO	R\$ -	R\$ -	
TOTAL DOS RECURSOS	R\$ 14.644.361,52	R\$ 10.753.359,15	

Quadro 14.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		RENTABILIDADE
	31/12/2021	30/12/2022	2022
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.554.337,82	R\$ 2.742.844,80	13,084%
NTN B (12/07/2022 - 15/05/2035)	R\$ -	R\$ 5.536.311,06	3,668%
NTN B (20/12/2022 - 15/08/2026)	R\$ -	R\$ 1.208.696,48	0,787%
TOTAL GERAL	R\$ 2.554.337,82	R\$ 9.487.852,34	

Quadro 15.

3.3 Total dos Recursos – ALE/FPREV

FUNDOS DE INVESTIMENTOS	31/12/2021	% dos Recursos	30/12/2022	% dos Recursos
	SALDO		SALDO	
FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 14.644.361,52	85,15%	R\$ 10.753.359,15	62,52%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.554.337,82	14,85%	R\$ 9.487.852,34	55,17%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	0,00%	R\$ 50.882,03	0,30%
TOTAL	R\$ 17.198.699,34		R\$ 20.292.093,52	

Quadro 16.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

3.4 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

1. Investimentos - Assembléia

Saldo dos Investimentos em 12/2021		R\$ 17.198.699,34	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2022	R\$ 330.496,56	R\$ 0,00	R\$ 330.496,56
02/2022	R\$ 181.051,78	R\$ 0,00	R\$ 181.051,78
03/2022	R\$ 182.602,86	R\$ 0,00	R\$ 182.602,86
04/2022	R\$ 187.717,42	R\$ 0,00	R\$ 187.717,42
05/2022	R\$ 225.494,08	R\$ 0,00	R\$ 225.494,08
06/2022	R\$ 206.676,04	R\$ 0,00	R\$ 206.676,04
07/2022	R\$ 208.176,70	R\$ 0,00	R\$ 208.176,70
08/2022	R\$ 195.200,20	R\$ 0,00	R\$ 195.200,20
09/2022	R\$ 211.199,86	R\$ 0,00	R\$ 211.199,86
10/2022	R\$ 209.483,44	R\$ 0,00	R\$ 209.483,44
11/2022	R\$ 208.368,70	R\$ 0,00	R\$ 208.368,70
12/2022	R\$ 215.348,54	R\$ 0,00	R\$ 215.348,54
Saldo dos Investimentos em 12/2022		R\$ 20.241.211,49	

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

Taxa de Juros Anual	4,9500 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	5,7848 %	5,7848 %	0,6200 %
Juros	4,9500 %	4,9500 %	0,4034 %
Meta	11,0212 %	11,0212 %	1,0259 %
Rentabilidade em %	2,6123 %	2,6123 %	-0,3826 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 480.695,97	R\$ 480.695,97	R\$ -76.919,25
Resultado em %	-7,5741 %	-7,5741 %	-1,3943 %
Resultado em R\$	R\$ -1.545.537,34	R\$ -1.545.537,34	R\$ -283.159,39

Quadro 17.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

4.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos

FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	SALDOS		RENTABILIDADE
	31/12/2021	30/12/2022	2022
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 7.679.290,50	R\$ -	-
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 78.696.812,90	R\$ -	-
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 3.289.156,56	R\$ -	-
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FIA RF	R\$ 1.626.133,37	R\$ -	-
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 91.291.393,33	R\$ -	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 40.540.838,53	R\$ -	-
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 1.664.692,02	R\$ 52.803.126,41	13,12%
BB PREVID RF PERFIL	R\$ -	R\$ -	-
SAFRA SOBERANO RP DI FIC REF	R\$ -	R\$ -	-
CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP	R\$ -	R\$ -	-
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 42.205.530,55	R\$ 52.803.126,41	
CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE		R\$ 1.822.087,86	-
TOTAL art. 7º, inciso IV	R\$ -	R\$ 1.822.087,86	
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ -	R\$ -	0,00%
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.296.125,92	R\$ 1.205.938,91	-6,960%
BB AÇÕES VALOR	R\$ 21.002.458,48	R\$ 20.273.612,19	-3,470%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 9.003.612,51	3,724%
OCCAM FIC FIA	R\$ -	R\$ 6.028.596,85	-5,486%
TARPON GT INST FIC FIA	R\$ -	R\$ 6.803.108,70	7,914%
TRIGONO FLAGSHIP INST FI FIA	R\$ -	R\$ 6.860.085,10	15,667%
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 23.288.292,57	R\$ -	0,000%
TOTAL art. 8º, inciso I - RENDA VARIÁVEL	R\$ 45.586.876,97	R\$ 50.174.954,26	
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 7.543.030,69	R\$ 6.643.881,00	5,94%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ -	R\$ 1.840.713,51	6,20%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 7.543.030,69	R\$ 8.484.594,51	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CC	R\$ 3.913.565,18	R\$ 8.625.991,08	
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	R\$ -	
TOTAL RECURSOS	R\$ 190.540.396,72	R\$ 121.910.754,12	

Quadro 18.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

4.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –MPE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		
	31/12/2021	30/12/2022	out/22
NTN-B (09/06/2022 - 15/08/2024)	R\$ -	R\$ 50.592.855,55	4,174%
NTN-B (12/07/22 - 15/05/2035)	R\$ -	R\$ 20.132.040,20	3,668%
NTN - B (13/12/2022 - 15/05/2025)	R\$ -	R\$ 12.109.662,23	0,914%
NTN B - (15/12/2022 - 15/08/2028)	R\$ -	R\$ 20.169.868,13	0,862%
TOTAL GERAL	R\$ 0,00	R\$ 103.004.426,11	

Quadro 19.

4.3 Total dos Recursos – MPE/FPREV

RECURSOS TJ/AM FPREV	31/12/2021	% dos Recursos	30/12/2022	% dos Recursos
	SALDO		SALDO	
FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 186.626.831,54	97,946%	R\$ 113.284.763,04	59,454%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ -	0,000%	R\$ 103.004.426,11	54,059%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 3.913.565,18	2,054%	R\$ 8.625.991,08	4,527%
TOTAL	R\$ 190.540.396,72		R\$ 224.915.180,23	

Quadro 20

4.4 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

1. Investimentos - Ministério Público

Saldo dos Investimentos em 12/2021				R\$ 190.540.396,72
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)	
01/2022	R\$ 1.169,74	R\$ 0,00	R\$ 1.169,74	
02/2022	R\$ 1.664.453,78	R\$ 20.395,10	R\$ 1.644.058,68	
03/2022	R\$ 1.660.420,76	R\$ 41.948,93	R\$ 1.618.471,83	
04/2022	R\$ 1.659.762,58	R\$ 16.778,94	R\$ 1.642.983,64	
05/2022	R\$ 1.689.107,22	R\$ 18.421,09	R\$ 1.670.686,13	
06/2022	R\$ 1.652.239,90	R\$ 34.635,86	R\$ 1.617.604,04	
07/2022	R\$ 1.640.438,74	R\$ 33.562,04	R\$ 1.606.876,70	
08/2022	R\$ 1.630.533,84	R\$ 33.562,04	R\$ 1.596.971,80	
09/2022	R\$ 1.637.208,36	R\$ 42.623,43	R\$ 1.594.584,93	
10/2022	R\$ 1.621.262,66	R\$ 46.725,64	R\$ 1.574.537,02	
11/2022	R\$ 1.613.014,95	R\$ 45.605,84	R\$ 1.567.409,11	
12/2022	R\$ 1.611.566,90	R\$ 89.462,79	R\$ 1.522.104,11	
Saldo dos Investimentos em 12/2022				R\$ 224.915.180,23

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

Taxa de Juros Anual	4,9500 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	5,7848 %	5,7848 %	0,6200 %
Juros	4,9500 %	4,9500 %	0,4034 %
Meta	11,0212 %	11,0212 %	1,0259 %
Rentabilidade em %	8,4485 %	8,4485 %	0,0312 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 16.717.325,78	R\$ 16.717.325,78	R\$ 69.636,94
Resultado em %	-2,3173 %	-2,3173 %	-0,9846 %
Resultado em R\$	R\$ -5.086.577,15	R\$ -5.086.577,15	R\$ -2.221.501,50

Quadro 21.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		Retabilidade
	31/12/2021	30/12/2022	2022
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGIA	R\$ 7.837.552,85	R\$ -	-
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 1.147.674,78	R\$ -	-
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 2.093.873,16	R\$ -	-
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 11.079.100,79	R\$ -	
BRADESCO INST. ALOC. DINAMICA	R\$ 8.641.653,63	R\$ -	-
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 9.569.604,29	R\$ -	-
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 1.174.869,42	R\$ 1.317.850,23	13,02%
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 19.386.127,34	R\$ 1.317.850,23	
CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE	R\$ -	R\$ 1.527.841,16	-
TOTAL art. 7º, inciso IV	R\$ -	R\$ 1.527.841,16	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 871.525,63	R\$ 810.883,14	-6,94%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 14.740,24	R\$ 15.104,79	5,65%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.734.677,14	R\$ 2.775.624,50	3,72%
BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	R\$ 846.661,14	R\$ -	0,00%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 3.467.604,15	R\$ 3.601.612,43	
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 3.761.909,47	R\$ 3.313.479,73	-11,92%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 1.734.806,69	R\$ 1.593.524,11	-8,00%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 5.496.716,16	R\$ 4.907.003,84	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CC	R\$ -	R\$ 27.013,93	
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	R\$ -	
TOTAL RECURSOS	R\$ 39.429.548,44	R\$ 11.381.321,59	

Quadro 22.

5.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –DPE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		RENTABILIDADE
	30/12/2022	30/12/2022	2022
NTN B (12/07/2022 - 15/05/2023)	R\$ -	R\$ 10.066.020,11	3,67%
NTN - B (13/12/2022 - 15/05/2025)	R\$ -	R\$ 35.319.848,17	0,91%
TOTAL GERAL	R\$ 0,00	R\$ 45.385.868,28	

Quadro 23.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

5.3 Total dos Recursos – DPE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	31/12/2021	% dos Recursos	30/12/2022	% dos Recursos
	SALDO		SALDO	
FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 39.429.548,44	100,00%	R\$ 11.381.321,59	20,04%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ -	0,00%	R\$ 45.385.868,28	79,91%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	0,00%	R\$ 27.013,93	0,05%
TOTAL	R\$ 39.429.548,44		R\$ 56.794.203,80	

Quadro 24

5.4 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV

1. Investimentos - Defensoria

Saldo dos Investimentos em 12/2021		R\$ 39.429.548,44	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2022	R\$ 0,00	R\$ 41.366,60	R\$ -41.366,60
02/2022	R\$ 1.248.223,40	R\$ 41.366,60	R\$ 1.206.856,80
03/2022	R\$ 1.254.503,15	R\$ 66.813,74	R\$ 1.187.689,41
04/2022	R\$ 1.254.391,51	R\$ 54.090,17	R\$ 1.200.301,34
05/2022	R\$ 1.239.427,94	R\$ 43.017,61	R\$ 1.196.410,33
06/2022	R\$ 1.265.619,51	R\$ 54.090,17	R\$ 1.211.529,34
07/2022	R\$ 1.314.247,49	R\$ 6.039,13	R\$ 1.308.208,36
08/2022	R\$ 1.289.382,39	R\$ 102.141,21	R\$ 1.187.241,18
09/2022	R\$ 1.297.425,41	R\$ 47.405,73	R\$ 1.250.019,68
10/2022	R\$ 1.312.094,85	R\$ 54.090,17	R\$ 1.258.004,68
11/2022	R\$ 1.325.950,25	R\$ 48.051,04	R\$ 1.277.899,21
12/2022	R\$ 1.340.533,16	R\$ 83.947,48	R\$ 1.256.585,68
Saldo dos Investimentos em 12/2022		R\$ 56.767.189,87	

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

Taxa de Juros Anual	4,9500 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	5,7848 %	5,7848 %	0,6200 %
Juros	4,9500 %	4,9500 %	0,4034 %
Meta	11,0212 %	11,0212 %	1,0259 %
Rentabilidade em %	8,5550 %	8,5550 %	0,4763 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 3.838.262,02	R\$ 3.838.262,02	R\$ 263.153,36
Resultado em %	-2,2214 %	-2,2214 %	-0,5440 %
Resultado em R\$	R\$ -1.103.582,15	R\$ -1.103.582,15	R\$ -303.645,89

Quadro 25.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjKzNjE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		RENTABILIDADE
	31/12/2021	30/12/2022	2022
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 163.955.412,81	R\$ -	-
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 51.597.045,77	R\$ -	-
BB PREV RF IDKA 2	R\$ 171.305.703,28	R\$ -	-
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 1.847.985,00	R\$ -	-
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 388.706.146,86	R\$ -	
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 1.572.013,64	R\$ 79.314.948,83	13,02%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 41.360.457,88	R\$ -	-
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 42.932.471,52	R\$ 79.314.948,83	
CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE	R\$ -	R\$ 52.269.305,91	0,0000%
TOTAL art. 7º, inciso IV	R\$ -	R\$ 52.269.305,91	R\$ -
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 2.829.052,97	R\$ 2.632.201,84	-6,9417%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 9.286.178,35	R\$ 9.515.842,52	2,4731%
OCCAM FIC FIA	R\$ -	R\$ 1.075.598,37	0,0000%
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ -	R\$ 1.223.949,21	0,0000%
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 1.220.368,02	0,0000%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 2.959.907,11	R\$ 6.046.840,63	3,7239%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 2.960.078,94	R\$ 4.621.132,80	0,1757%
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 4.155.004,91	R\$ -	0,0000%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 22.190.222,28	R\$ 26.335.933,39	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 31.652.771,81	R\$ 25.559.952,86	-19,25%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 31.652.771,81	R\$ 25.559.952,86	
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 20.068.461,87	R\$ 17.676.247,11	-11,92%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 20.068.461,87	R\$ 17.676.247,11	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1.268.056,82	R\$ 5.606.412,76	
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	R\$ -	
TOTAL	R\$ 506.818.131,16	R\$ 206.762.800,86	

Quadro 26.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

6.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos – TJAM/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		REANTABILIDADE
	31/12/2021	30/12/2022	2022
NTN-B (11/02/22 - 15/05/23)	R\$ -	R\$ 41.880.812,18	11,0416%
NTN-B (16/06/22 - 15/05/23)	R\$ -	R\$ 202.994.954,02	4,4883%
NTN-B (12/07/2022 - 15/05/2035)	R\$ -	R\$ 47.813.598,46	3,6675%
NTN - B (13/12/2022 - 15/05/2025)	R\$ -	R\$ 3.025.882,61	0,9139%
NTN - B (13/12/2022 - 15/05/2027)	R\$ -	R\$ 40.364.085,49	0,9073%
NTN - B (15/12/2022 - 15/08/2024)	R\$ -	R\$ 50.448.655,06	0,9011%
TOTAL GERAL	R\$ -	R\$ 386.527.987,82	

Quadro 27

6.3 Total dos Recursos – TJAM/FPREV

RECURSOS TJ/AM FPREV	31/12/2021	% dos Recursos	30/12/2022	% dos Recursos
	SALDO		SALDO	
FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 505.550.074,34	99,75%	R\$ 201.156.388,10	39,69%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ -	0,00%	R\$ 386.527.987,82	76,27%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1.268.056,82	0,25%	R\$ 5.606.412,76	1,11%
TOTAL	R\$ 506.818.131,16		R\$ 593.290.788,68	

Quadro 28

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

6.4 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Justiça

Saldo dos Investimentos em 12/2021			R\$ 506.818.131,16
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2022	R\$ 5.672.474,97	R\$ 302.640,83	R\$ 5.369.834,14
02/2022	R\$ 56.570,27	R\$ 356.405,95	R\$ -299.835,68
03/2022	R\$ 7.951.840,91	R\$ 323.754,43	R\$ 7.628.086,48
04/2022	R\$ 4.109.557,59	R\$ 36.232,72	R\$ 4.073.324,87
05/2022	R\$ 24.966,47	R\$ 623.560,78	R\$ -598.594,31
06/2022	R\$ 8.338.800,59	R\$ 308.280,26	R\$ 8.030.520,33
07/2022	R\$ 4.283.886,16	R\$ 333.045,61	R\$ 3.950.840,55
08/2022	R\$ 4.331.931,11	R\$ 455.010,26	R\$ 3.876.920,85
09/2022	R\$ 4.327.276,05	R\$ 353.459,00	R\$ 3.973.817,05
10/2022	R\$ 4.288.452,36	R\$ 351.916,60	R\$ 3.936.535,76
11/2022	R\$ 4.407.617,21	R\$ 355.001,41	R\$ 4.052.615,80
12/2022	R\$ 8.528.187,87	R\$ 425.895,65	R\$ 8.102.292,22
Saldo dos Investimentos em 12/2022			R\$ 593.290.788,68

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

Taxa de Juros Anual	4,9500 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	5,7848 %	5,7848 %	0,6200 %
Juros	4,9500 %	4,9500 %	0,4034 %
Meta	11,0212 %	11,0212 %	1,0259 %
Rentabilidade em %	6,5074 %	6,5074 %	0,7237 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 34.376.299,46	R\$ 34.376.299,46	R\$ 4.204.558,66
Resultado em %	-4,0657 %	-4,0657 %	-0,2992 %
Resultado em R\$	R\$ -23.826.791,73	R\$ -23.826.791,73	R\$ -1.755.920,18

Quadro 29.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		RENTABILIDADE
	31/12/2021	30/12/2022	mai/20
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 42.018.824,25	R\$ -	-
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 32.039.840,92	R\$ -	-
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 21.423.676,45	R\$ -	-
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 297.747,60	R\$ -	-
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 95.780.089,22	R\$ -	
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 304.436,43	R\$ 19.876.175,02	13,04%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 7.677.996,48		0,00%
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 7.982.432,91	R\$ 19.876.175,02	
CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE	R\$ -	R\$ 26.514.993,31	0,00%
TOTAL art. 7º, inciso IV	R\$ -	R\$ 26.514.993,31	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 764.303,19	R\$ 711.121,46	-7,050%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT.	R\$ 9.286.178,35	R\$ 9.515.842,52	2,473%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 859.592,91	R\$ 1.400.616,74	3,724%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 859.642,80	R\$ 861.163,05	0,176%
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 441.891,72	R\$ -	0,00%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 12.211.608,97	R\$ 12.488.743,77	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 605.378,59	R\$ 488.849,71	-19,25%
TOTAL art 9º - A - II -	R\$ 605.378,59	R\$ 488.849,71	
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 3.744.251,95	R\$ 3.297.927,03	-11,92%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 3.744.251,95	R\$ 3.297.927,03	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 2.924.055,24	
VALORES EM TRANSITO	R\$ -	R\$ -	
TOTAL	R\$ 120.323.761,64	R\$ 65.590.744,08	

Quadro 30.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

7.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –TCE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		RENTABILIDADE
	31/12/2021	30/12/2022	2022
NTN B (12/07/2022 - 15/05/2035)	R\$ -	R\$ 17.112.234,17	2,062%
NTN - B (13/12/2022 - 15/05/2027)	R\$ -	R\$ 10.090.732,86	2,109%
NTN - B (15/12/2022 - 15/08/2024)	R\$ -	R\$ 50.448.655,06	0,901%
TOTAL GERAL	R\$ 0,00	R\$ 77.651.622,10	

Quadro 31

7.3 Total dos Recursos – TCE/FPREV

RECURSOS TJ/AM FPREV	31/12/2021	% dos	30/12/2022	% dos
	SALDO	Recursos	SALDO	Recursos
FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 120.323.761,64	100,000%	R\$ 62.666.688,84	43,749%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ -	0,00%	R\$ 77.651.622,10	54,210%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	0,00%	R\$ 2.924.055,24	2,041%
TOTAL	R\$ 120.323.761,64		R\$ 143.242.366,18	

Quadro 32

7.4 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Contas

Saldo dos Investimentos em 12/2021		R\$ 120.323.761,64	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2022	R\$ 4.958,52	R\$ 0,00	R\$ 4.958,52
02/2022	R\$ 1.449.125,02	R\$ 24.900,86	R\$ 1.424.224,16
03/2022	R\$ 700.731,13	R\$ 39.696,10	R\$ 661.035,03
04/2022	R\$ 723.931,36	R\$ 0,00	R\$ 723.931,36
05/2022	R\$ 730.190,58	R\$ 64.596,96	R\$ 665.593,62
06/2022	R\$ 752.226,14	R\$ 57.988,93	R\$ 694.237,21
07/2022	R\$ 743.489,44	R\$ 7.489,13	R\$ 736.000,31
08/2022	R\$ 820.598,04	R\$ 106.726,53	R\$ 713.871,51
09/2022	R\$ 980.772,84	R\$ 32.298,48	R\$ 948.474,36
10/2022	R\$ 817.771,29	R\$ 32.298,48	R\$ 785.472,81
11/2022	R\$ 957.070,80	R\$ 38.906,51	R\$ 918.164,29
12/2022	R\$ 1.730.199,65	R\$ 39.809,66	R\$ 1.690.389,99
Saldo dos Investimentos em 12/2022		R\$ 143.242.366,18	

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

Taxa de Juros Anual	4,9500 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	5,7848 %	5,7848 %	0,6200 %
Juros	4,9500 %	4,9500 %	0,4034 %
Meta	11,0212 %	11,0212 %	1,0259 %
Rentabilidade em %	10,4333 %	10,4333 %	0,7671 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 12.952.251,37	R\$ 12.952.251,37	R\$ 1.077.577,55
Resultado em %	-0,5295 %	-0,5295 %	-0,2562 %
Resultado em R\$	R\$ -729.352,10	R\$ -729.352,10	R\$ -363.589,11

Quadro 33.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV

1. Investimentos - CONSOLIDADO

Saldo dos Investimentos em 12/2021			R\$ 6.009.425.317,93
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2022	R\$ 21.018.770,26	R\$ 10.807.477,47	R\$ 10.211.292,79
02/2022	R\$ 51.340.679,94	R\$ 13.826.886,01	R\$ 37.513.793,93
03/2022	R\$ 58.711.099,75	R\$ 11.911.920,48	R\$ 46.799.179,27
04/2022	R\$ 53.164.621,36	R\$ 11.053.770,06	R\$ 42.110.851,30
05/2022	R\$ 50.082.174,56	R\$ 16.076.811,16	R\$ 34.005.363,40
06/2022	R\$ 59.319.428,77	R\$ 11.397.350,62	R\$ 47.922.078,15
07/2022	R\$ 55.739.597,82	R\$ 11.280.660,01	R\$ 44.458.937,81
08/2022	R\$ 56.431.133,95	R\$ 13.000.428,99	R\$ 43.430.704,96
09/2022	R\$ 56.937.314,05	R\$ 11.257.556,08	R\$ 45.679.757,97
10/2022	R\$ 56.154.596,15	R\$ 11.305.467,55	R\$ 44.849.128,60
11/2022	R\$ 55.977.403,03	R\$ 12.023.201,52	R\$ 43.954.201,51
12/2022	R\$ 124.106.593,11	R\$ 17.179.517,14	R\$ 106.927.075,97
Saldo dos Investimentos em 12/2022			R\$ 6.818.754.230,95

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

Taxa de Juros Anual	4,9500 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	5,7848 %	5,7848 %	0,6200 %
Juros	4,9500 %	4,9500 %	0,4034 %
Meta	11,0212 %	11,0212 %	1,0259 %
Rentabilidade em %	4,2098 %	4,2098 %	0,2349 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 261.466.547,36	R\$ 261.466.547,36	R\$ 15.731.833,83
Resultado em %	-6,1352 %	-6,1352 %	-0,7830 %
Resultado em R\$	R\$ -422.755.824,40	R\$ -422.755.824,40	R\$ -52.965.305,43

Quadro 34.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

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

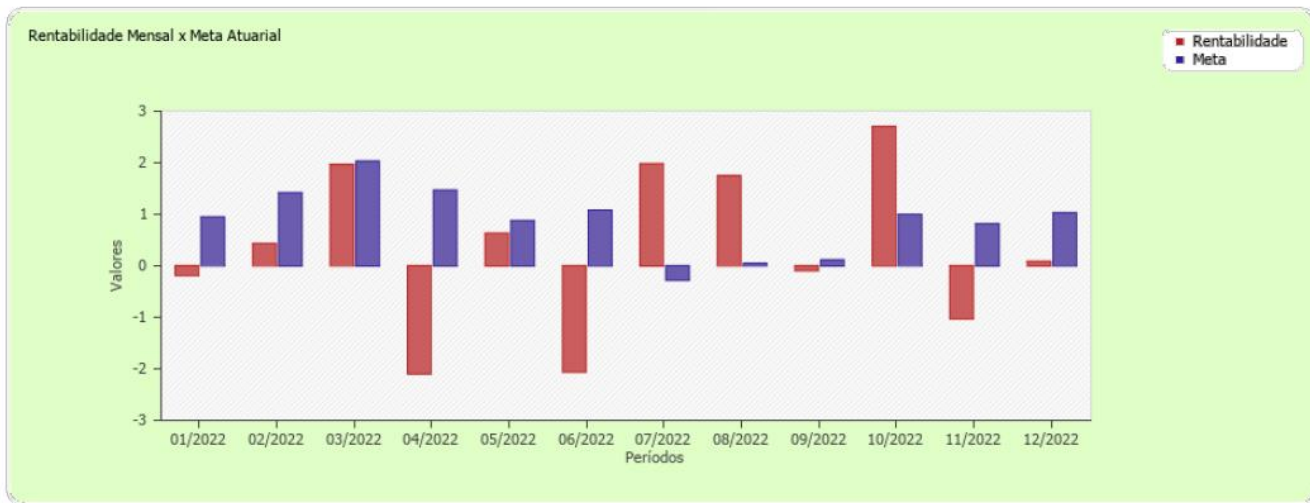


Gráfico 1.

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

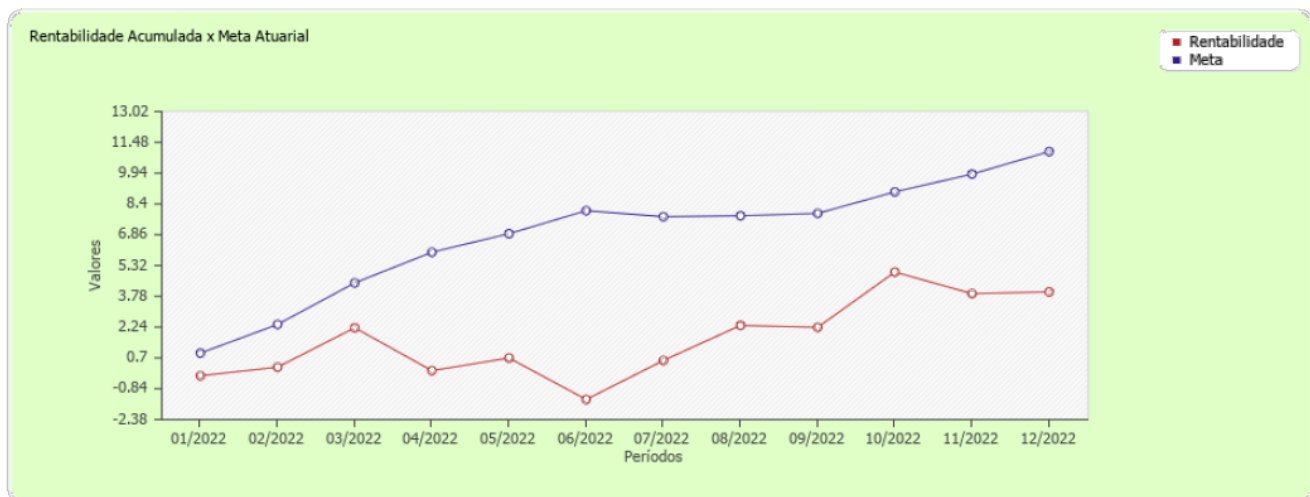


Gráfico 2.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/12/2021	30/12/2022
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 20.700.266,91	R\$ 2.755.850,94
FUNDO BRADESCO RF - COMPREV	R\$ 6.259.794,93	R\$ 11.567.375,56
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 0,02	R\$ 5.056,68
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 3.320.989,92	R\$ 53.852,62
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 264.295,10	R\$ 237.999,46
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 23.432.002,70	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - COMPREV	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 53.977.349,58	R\$ 14.620.135,26

Quadro 35.

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

9.2 FPPM – Fundo de Proteção Previdenciária dos Militares

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/12/2021	30/12/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R\$ 24.930.709,80	R\$ 4.912.116,18
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R\$ 453,96	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ 24.806,63	R\$ 24.617,98
TOTAL	R\$ 24.955.970,39	R\$ 4.936.734,16

Quadro 36.

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

9.3 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/12/2021	30/12/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 803.859,92	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 160,20
TOTAL	R\$ 803.859,92	R\$ 160,20

Quadro 37.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/12/2021	30/12/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 451.032,00	R\$ 3.342,72
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 2.075,62	R\$ 2.175,62
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ -
TOTAL	R\$ 453.108,62	R\$ 5.518,34

Quadro 38.

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/12/2021	30/12/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 3.172.933,30	R\$ 1.090.332,03
CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 6.066.281,79	R\$ -
TOTAL	R\$ 9.239.215,09	R\$ 1.090.332,03

Quadro 39.

9.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/12/2021	30/12/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 12.279.664,11	R\$ 14.080.633,88
CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	R\$ 602.764,51	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ -
TOTAL	R\$ 12.882.429,62	R\$ 14.080.633,88

Quadro 40.

9.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/12/2021	30/12/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.808.646,58	R\$ 1.618.817,12
CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE COBERTURA TCE FFIN	R\$ 1.946.837,55	R\$ 5.884,33
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 28.167,48	R\$ -
TOTAL	R\$ 4.783.651,61	R\$ 1.624.701,45

TOTAL GERAL FFIN	R\$ 107.095.584,83	R\$ 36.358.215,32
-------------------------	---------------------------	--------------------------

Quadro 41.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Evolução do Saldo de Taxa de Administração

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/12/2021	30/12/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.143,62	R\$ 961.974,54
CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE		R\$ 978,98
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 40.560.407,77	R\$ 22.023.255,82
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ -
TOTAL PODER EXECUTIVO	R\$ 40.561.552,39	R\$ 22.986.209,34
DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/12/2021	30/12/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 35.718,27	R\$ -
TOTAL - ALE	R\$ 35.718,27	R\$ -
DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/12/2021	30/12/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 61.970,46	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ -
TOTAL - TCE	R\$ 61.971,46	R\$ -
DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/12/2021	30/12/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 605.835,00	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL TJ/AM	R\$ 605.835,00	R\$ -
DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/12/2021	30/12/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 199.434,03	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL PGJ/AM	R\$ 199.434,03	R\$ -
TOTAL GERAL	R\$ 41.464.511,15	R\$ 22.986.209,34

Quadro 42.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjKzNjE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

11. ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS

11.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2022		Resolução CMN nº 4.963/21
			ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE SUPERIOR	
TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL	R\$ 3.091.635.045,96	45,61%	30,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
TOTAL art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 3.091.635.045,96				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 7.885.247,87	2,10%	9,00%	100,00%	art. 7º, Inciso I, "b"
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 55.189.263,72				
SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	R\$ 78.858.235,25				
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 98.145,85				
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 142.030.892,69				
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 30.459.468,00	9,29%	5,00%	70,00%	art. 7º, inciso III, "a"
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 371.943.807,36				
ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 3.542.275,02				
ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LP	R\$ 109.670.728,66				
BB PREVID RF PERFIL	R\$ -				
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 114.354.489,57				
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 629.970.768,61				
CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE	R\$ 232.675.483,20	3,43%	1,00%	20,00%	art. 7º, inciso IV
TOTAL art. 7º, inciso IV	R\$ 232.675.483,20				
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 2.259.367,15	9,81%	10,00%	10,00%	art 7º, inciso V, "b"
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 120.910.991,78				
ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 147.168.816,77				
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 99.828.572,85				
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 62.490.499,08				
PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R\$ 146.779.351,67				
BNP PARIBAS MAC TH DI FI RF REF	R\$ 72.803.692,52				
RIO BRAVO CREDITO PRIVADO FI RF	R\$ 12.431.340,24				
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 664.672.632,06				
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 4.760.984.822,52	70,24%			

Quadro 43.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

11.2 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Variável

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2022		Resolução CMN nº 4.963/21
			ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE SUPERIOR	
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 66.723.073,47	22,04%	40,00%	40,00%	art. 8º, inciso I
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 70.345.239,26				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 118.527.546,61				
BB SELEÇÃO FATOR FIC FI	R\$ 49.767.266,24				
BRABESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 112.267.636,26				
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 43.715.099,18				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 185.786.482,44				
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 31.831.747,06				
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.352.468,46				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 81.311.552,03				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 93.874.541,89				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 69.154.719,11				
OCCAM FIC FIA	R\$ 119.142.731,56				
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 93.214.497,15				
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 78.742.664,68				
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 40.709.417,60				
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 49.506.181,90				
TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 68.123.567,30				
4UM SMALL CAPS FIA	R\$ 39.787.362,84				
TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 4.750.832,68				
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 40.039.781,67				
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	R\$ 4.182.085,85				
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 14.109.109,63				
TOTAL art. 8º, inciso I, "a"	R\$ 1.493.965.604,87				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.493.965.604,87	22,04%			

Quadro 44.

11.3 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Investimentos no Exterior

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2022		Resolução CMN nº 4.963/21
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 47.028.246,43	2,39%	5,00%	10,00%	art 9º-A, inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 32.447.139,23				
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 12.838.980,43				
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 44.790.174,49				
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 25.059.710,90				
TOTAL art 9º, inciso II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 162.164.251,48				
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	R\$ 56.680.008,07	2,01%	5,00%		art 9º-A, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NÍVEL I	R\$ 44.048.915,69				
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES	R\$ 35.734.854,74				
TOTAL art 9º, inciso III - BDR Nível I	R\$ 136.463.778,50				
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 298.628.029,98	4,41%			

Quadro 45.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

11.4 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Fundos Estruturados

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2022		Resolução CMN nº 4.963/21
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 31.624.240,50	2,25%	5,00%	10,00%	art. 10º, inciso I, a
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 32.804.508,60				
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 150.198,45				
FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$ 15.383.696,84				
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ 17.081.845,43				
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM	R\$ 10.287.728,13				
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$ 30.085.990,02				
RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$ 15.325.287,61				
TOTAL art. 10º, inciso I, "a"	R\$ 152.743.495,58				
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 35.218.329,99	1,06%	2,00%	5,00%	art. 10º, inciso I, b
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 19.233.118,99				
CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$ 1.112.237,95				
KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$ 15.993.362,43				
TOTAL art. 10º, inciso I, "b"	R\$ 71.557.049,36				
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 224.300.544,94	3,31%			
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 6.777.879.002,31	100%			

Quadro 46.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO		TOTAL APLICADO	% CARTEIRA	LIMITE NO PL DO RPPS POR FUNDO
FI RF - 100% TPF	BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 7.885.247,87	0,11%	100%
	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 55.189.263,72	0,80%	
FI RENDA FIXA	BRANCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 30.459.468,00	0,44%	20%
	BRANCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 371.943.807,36	5,42%	
	BB PREVID RF PERFIL	R\$ -	0,00%	
	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 114.354.489,57	1,67%	
	ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LP - FUNDO NOVO	R\$ 109.670.728,66	1,60%	
	ITAU SOBERANO SIMPLES FIC - FUNDO NOVO	R\$ 3.542.275,02	0,05%	
	SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	R\$ 78.858.235,25	1,15%	
	ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 98.145,85	0,00%	
FI RF CREDITO PRIVADO	ICATU VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 2.259.367,15	0,03%	20%
	SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 120.910.991,78	1,76%	
	ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 147.168.816,77	2,14%	
	BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 99.828.572,85	1,45%	
	PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R\$ 146.779.351,67	2,14%	
	BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF	R\$ 72.803.692,52	1,06%	
	RIO BRAVO CREDITO PRIVADO FI RF	R\$ 12.431.340,24	0,18%	
	MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 62.490.499,08	0,91%	
CDB	CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE	R\$ 232.675.483,20	3,39%	15%
FUNDOS DE AÇÕES	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 66.723.073,47	0,97%	20%
	AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 70.345.239,26	1,02%	
	BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 118.527.546,61	1,73%	
	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 49.767.266,24	0,72%	
	BRANCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 112.267.636,26	1,63%	
	BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 43.715.099,18	0,64%	
	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 185.786.482,44	2,71%	
	CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 31.831.747,06	0,46%	
	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.352.468,46	0,27%	
	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 81.311.552,03	1,18%	
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 93.874.541,89	1,37%	
	ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 69.154.719,11	1,01%	
	OCCAM FIC FIA	R\$ 119.142.731,56	1,73%	
	VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 93.214.497,15	1,36%	
	GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 78.742.664,68	1,15%	
	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 40.709.417,60	0,59%	
	TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 49.506.181,90	0,72%	
	TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 68.123.567,30	0,99%	
	TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 4.750.832,68	0,07%	
	CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 40.039.781,67	0,58%	
	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	R\$ 4.182.085,85	0,06%	
	CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 14.109.109,63	0,21%	
	4UM SMALL CAPS FIA	R\$ 39.787.362,84	0,58%	
INVEST NO EXTERIOR - FI	BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 47.028.246,43	0,68%	20%
	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 32.447.139,23	0,47%	
	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 12.838.980,43	0,19%	
	SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 44.790.174,49	0,65%	
	SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 25.059.710,90	0,36%	
FIA - BDR	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 56.680.008,07	0,83%	20%
	ITAÚ BDR NIVE 1 AÇÕES	R\$ 35.734.854,74	0,52%	
	SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 44.048.915,69	0,64%	
FUNDOS MULTIMERCADO	SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 31.624.240,50	0,46%	20%
	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 32.804.508,60	0,48%	
	ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 150.198,45	0,00%	
	FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$ 15.383.696,84	0,22%	
	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ 17.081.845,43	0,25%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM - FUNDO NOVO	R\$ 10.287.728,13	0,15%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$ 30.085.990,02	0,44%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$ 15.325.287,61	0,22%	
FIP	BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 35.218.329,99	0,51%	20%
	KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$ 15.993.362,43	0,23%	
	CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$ 1.112.237,95	0,02%	
	BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 19.233.118,99	0,28%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO		R\$ 3.686.243.956,35		

Quadro 47.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO		TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL DO FUNDO	LIMITE RESOL. CMN 4.963/21
FI RF - 100% TPF	BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 7.885.247,87	R\$ 12.858.761.791,29	0,06%	100%
	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 55.189.263,72	R\$ 225.226.282,56	24,50%	
FI RENDA FIXA	BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 30.459.468,00	R\$ 476.291.839,50	6,40%	15%
	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 371.943.807,36	R\$ 7.627.582.136,16	4,88%	
	BB PREVID RF PERFIL	R\$ -	R\$ 12.858.761.791,29	0,00%	
	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 114.354.489,57	R\$ 13.943.633.561,86	0,82%	
	ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LP	R\$ 109.670.728,66	R\$ 747.369.796,31	14,67%	
	ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 3.542.275,02	R\$ 27.822.942.011,94	0,01%	
	SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	R\$ 78.858.235,25	R\$ 3.484.971.718,10	2,26%	
	ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 98.145,85	R\$ 2.189.575.950,42	0,00%	
FI RF CREDITO PRIVADO	ICATU VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 2.259.367,15	R\$ 1.369.079.222,31	0,17%	5%
	SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 120.910.991,78	R\$ 2.684.723.806,11	4,50%	
	ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 147.168.816,77	R\$ 3.969.011.851,26	3,71%	
	BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 99.828.572,85	R\$ 2.988.606.061,79	3,34%	
	PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R\$ 146.779.351,67	R\$ 5.220.944.444,89	2,81%	
	BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF	R\$ 72.803.692,52	R\$ 4.715.386.460,02	1,54%	
	RIO BRAVO CREDITO PRIVADO FI RF	R\$ 12.431.340,24	R\$ 393.793.345,56	3,16%	
	MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 62.490.499,08	R\$ 1.295.296.130,64	4,82%	
FUNDOS DE AÇÕES	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 66.723.073,47	R\$ 740.791.723,00	9,01%	15%
	AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 70.345.239,26	R\$ 1.439.263.085,26	4,89%	
	BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 118.527.546,61	R\$ 987.099.652,68	12,01%	
	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 49.767.266,24	R\$ 1.369.079.222,31	3,64%	
	BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 112.267.636,26	R\$ 893.768.575,50	12,56%	
	BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 43.715.099,18	R\$ 318.164.936,07	13,74%	
	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 185.786.482,44	R\$ 1.373.628.350,10	13,53%	
	CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 31.831.747,06	R\$ 506.643.009,29	6,28%	
	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.352.468,46	R\$ 148.727.105,20	12,34%	
	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 81.311.552,03	R\$ 904.482.272,88	8,99%	
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 93.874.541,89	R\$ 1.879.797.625,43	4,99%	
	ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 69.154.719,11	R\$ 548.962.862,29	12,60%	
	OCCAM FIC FIA	R\$ 119.142.731,56	R\$ 991.881.622,41	12,01%	
	VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 93.214.497,15	R\$ 833.769.932,26	11,18%	
	GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 78.742.664,68	R\$ 859.169.719,10	9,16%	
	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 40.709.417,60	R\$ 535.560.916,74	7,60%	
	TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 49.506.181,90	R\$ 989.019.644,80	5,01%	
	TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 68.123.567,30	R\$ 590.953.322,47	11,53%	
	TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 4.750.832,68	R\$ 97.814.521,98	4,86%	
	CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 40.039.781,67	R\$ 1.212.571.725,68	3,30%	
	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	R\$ 4.182.085,85	R\$ 328.007.076,41	1,27%	
	CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 14.109.109,63	R\$ 548.029.386,77	2,57%	
	4UM SMALL CAPS FIA	R\$ 39.787.362,84	R\$ 328.007.076,41	12,13%	
INVEST NO EXTERIOR - FI	BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 47.028.246,43	R\$ 1.216.732.605,32	3,87%	15%
	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 32.447.139,23	R\$ 107.130.105.850,39	0,03%	
	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 12.838.980,43	R\$ 12.423.047.296,08	0,10%	
	SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 44.790.174,49	R\$ 996.043.275,47	4,50%	
	SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 25.059.710,90	R\$ 17.564.513.792,89	0,14%	
FIA - BDR	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 56.680.008,07	R\$ 1.279.513.840,76	4,43%	15%
	ITAÚ BDR NIVEL 1 AÇÕES	R\$ 35.734.854,74	R\$ 208.983.799,03	17,10%	
	SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 44.048.915,69	R\$ 910.995.998,19	4,84%	
FUNDOS MULTIMERC ADO	SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 31.624.240,50	R\$ 643.989.310,17	4,91%	15%
	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 32.804.508,60	R\$ 435.575.393,61	7,53%	
	ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 150.198,45	R\$ 1.178.133.424,16	0,01%	
	FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$ 15.383.696,84	R\$ 110.804.751,51	13,88%	
	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ 17.081.845,43	R\$ 161.014.511,10	10,61%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM - FUNDO NOVO	R\$ 10.287.728,13	R\$ 161.319.375,60	6,38%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$ 30.085.990,02	R\$ 206.688.562,79	14,56%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$ 15.325.287,61	R\$ 128.998.626,49	11,88%	
FIP	BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 35.218.329,99	R\$ 2.533.391.882,66	1,39%	15%
	KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$ 15.993.362,43	R\$ 333.428.176,63	4,80%	
	CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$ 1.112.237,95	R\$ 10.269.855,49	10,83%	
	BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 19.233.118,99	R\$ 395.520.763,16	4,86%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO		R\$ 3.453.568.473,15			

Quadro 48.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

11.7 Enquadramento IV – Limites Gerais – art. 20º - A - Res. CMN 4.963/202

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA NOVEMBRO/2022 EM R\$ MI	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (DEZEMBRO/22)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 4.963/21
BB DTVM S.A	R\$ 1.466.406,17	R\$ 279.888.315,22	0,0191%	5%
CAIXA	R\$ 495.369,79	R\$ 250.922.888,05	0,0507%	
ITAU	R\$ 854.676,44	R\$ 349.723.551,83	0,0409%	
SAFRA	R\$ 95.411,44	R\$ 154.531.391,44	0,1620%	
BRDESCO	R\$ 575.691,45	R\$ 980.021.878,02	0,1702%	
ICATÚ	R\$ 42.401,08	R\$ 193.241.647,84	0,4557%	
BTG PACTUAL	R\$ 273.952,84	R\$ 372.871.012,87	0,1361%	
SANTANDER	R\$ 310.610,83	R\$ 165.701.166,27	0,0533%	
VINCI	R\$ 47.511,12	R\$ 135.036.152,70	0,2842%	
OCCAM	R\$ 10.517,12	R\$ 119.142.731,56	1,1328%	
PLURAL INVEST	R\$ 49.206,97	R\$ 45.286.119,66	0,0920%	
AZ QUEST	R\$ 22.877,02	R\$ 70.345.239,26	0,3075%	
BC GESTAO	R\$ 4.154,61	R\$ 43.715.099,18	1,0522%	
ARX	R\$ 34.047,35	R\$ 66.723.073,47	0,1960%	
SCHRODER	R\$ 27.219,01	R\$ 25.059.710,90	0,0921%	
MONGERAL	R\$ 10.804,54	R\$ 62.490.499,08	0,5784%	
DAYCOVAL	R\$ 11.649,36	R\$ 18.352.468,46	0,1575%	
GUEPARDO	R\$ 2.090,97	R\$ 78.742.664,68	3,7658%	
4UM	R\$ 1.991,17	R\$ 43.969.448,69	2,2082%	
TRIGONO	R\$ 2.706,39	R\$ 54.257.014,58	2,0048%	
TARPON	R\$ 6.159,26	R\$ 68.123.567,30	1,1060%	
RIO BRAVO	R\$ 9.746,74	R\$ 78.418.074,13	0,8046%	
PORTO SEGURO	R\$ 20.255,37	R\$ 146.779.351,67	0,7246%	
CONSTANCIA	R\$ 1.655,49	R\$ 40.039.781,67	2,4186%	
BNP PARIBAS	R\$ 60.879,10	R\$ 72.803.692,52	0,1196%	
KINEA	R\$ 72.365,70	R\$ 15.993.362,43	0,0221%	
CLARITAS	R\$ 7.526,01	R\$ 14.109.109,63	0,1875%	

Quadro 49.

Nota 1: Para fins desse enquadramento, é aplicado o Ranking ANBIMA, atualizado bimestralmente, para o Gestores de Recursos de Terceiros.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	2021	% dos Recursos	2022	% dos Recursos
	SALDO		SALDO	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 5.290.907.196,15	85,89%	R\$ 3.686.243.956,25	59,84%
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 752.788.585,51	12,22%	R\$ 3.101.722.106,85	50,35%
TÍTULOS - CVS	R\$ 8.712.029,37	0,14%	R\$ 7.083.711,95	0,11%
IMÓVEIS	R\$ 68.293.435,00	1,11%	R\$ 65.484.778,63	1,06%
VALORES EM TRÂNSITO		0,00%	R\$ -	0,00%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 39.050.926,31	0,63%	R\$ 17.564.101,93	0,29%
TOTAL	R\$ 6.159.752.172,34		R\$ 6.878.098.655,61	

Quadro 50.

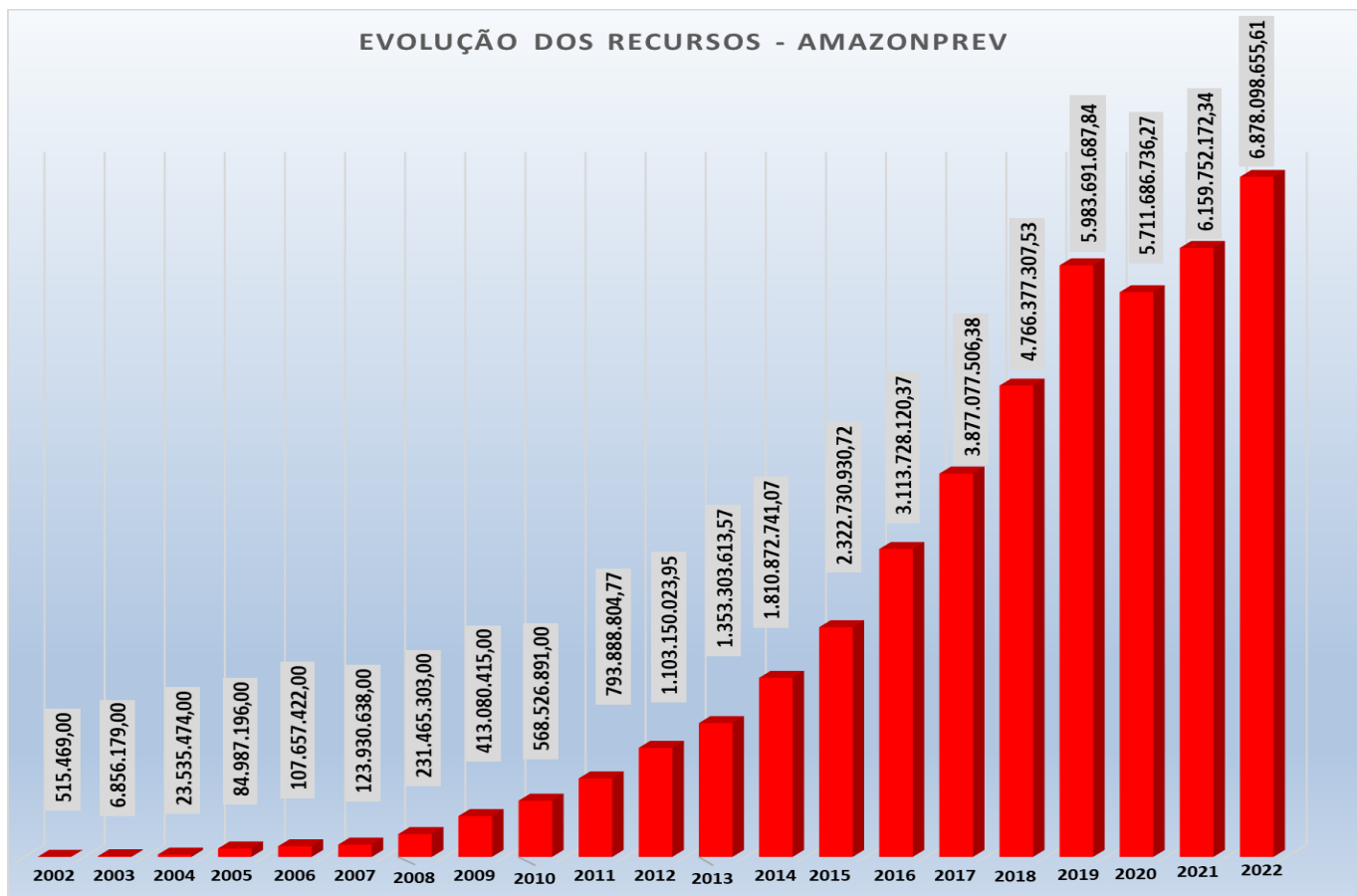


Gráfico 03

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjKzNjE1



RELATÓRIOS - 2022

RELATÓRIO DE RISCOS FPREV - AMAZONPREV

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

TOTAL RENDA FIXA	R\$	4.479.123.127,65
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$	1.688.180.159,69
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$	298.628.029,98
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$	6.465.931.317,32

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso I, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	dez/22	2022
						RETORNO	RETORNO	RETORNO
TÍTULOS PÚBLICOS DO TESOURO	R\$ 2.772.466.968,18	R\$ 3.101.722.106,85						
TOTAL - art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 2.772.466.968,18	R\$ 3.101.722.106,85						
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso I, "b"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	dez/22	2022
						RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Prev RF Tit Publ VII FI	R\$ 7.798.352,18	R\$ 7.885.247,87	1,40%	0,15%	-0,91	13,98%	1,11%	13,98%
Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	R\$ 54.472.245,29	R\$ 55.189.263,72	5,00%	0,51%	-2,90	3,08%	1,32%	3,08%
Safra Sob Reg Proprio Fc FI RF Ref DI	R\$ 182.512.383,86	R\$ 78.858.235,25	0,09%	0,01%	0,00	12,31%	1,12%	12,31%
Itau Instit Alocacao Dinamica RF FICFI	R\$ 98.510,13	R\$ 98.145,85	3,07%	0,32%	-0,74	7,83%	-0,37%	7,83%
TOTAL - art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 244.881.491,46	R\$ 142.030.892,69						
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso III, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	dez/22	2022
						RETORNO	RETORNO	RETORNO
Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	R\$ 17.105,99	R\$ 17.288,85	0,09%	0,01%	0,00	11,79%	1,07%	11,79%
Bradesco FI RF Ref DI Premium	R\$ 109.676.488,26	R\$ 365.135.969,77	0,09%	0,01%	0,00	13,00%	1,17%	13,00%
Caixa FI Brasil RF Ref DI LP	R\$ 208.547.565,00	R\$ 92.331.233,75	0,10%	0,01%	0,00	12,67%	1,15%	12,67%
Itau Soberano RF Simples Fc	R\$ 102.463.090,06	R\$ 3.542.275,02	0,08%	0,01%	0,00	12,35%	1,10%	12,35%
Icatu Vanguarda RF FI Plus LP	R\$ 108.434.621,88	R\$ 109.670.728,66	0,31%	0,03%	-0,03	12,73%	1,14%	12,73%
BB Prev RF Ref DI LP Perfil Fc	R\$ 289.606.213,85	R\$ -	0,09%	0,01%	0,00	12,59%	1,12%	12,59%
TOTAL - art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 818.745.085,04	R\$ 570.697.496,05						
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso V, "b"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	dez/22	2022
						RETORNO	RETORNO	RETORNO
Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	R\$ 2.236.339,00	R\$ 2.259.367,15	3,40%	0,35%	-1,68	10,95%	1,03%	10,95%
Mag Cred Priv FI RF LP	R\$ 61.737.702,93	R\$ 62.490.499,08	0,12%	0,01%	0,00	13,61%	1,22%	13,61%
Sant RF Cred Priv Crescimento Inst FI LP	R\$ 119.500.510,90	R\$ 120.910.991,78	0,14%	0,01%	-0,02	13,52%	1,18%	13,52%
BTG Pact Cre Cor I Fc FI RF Cred Priv LP	R\$ 98.649.141,11	R\$ 99.828.572,85	0,17%	0,02%	0,00	14,24%	1,20%	14,24%
Porto Seguro FI RF Refer DI Cred Priv	R\$ 145.463.980,25	R\$ 147.168.816,77	0,09%	0,01%	0,00	13,21%	1,17%	13,21%
Bnpp Match DI FI RF Ref Cred Priv	R\$ 71.970.030,75	R\$ 72.803.692,52	0,09%	0,01%	0,00	13,13%	1,16%	13,13%
Rio Bravo Cred Priv FI RF	R\$ 12.283.397,93	R\$ 12.431.340,24	0,18%	0,02%	-0,07	13,55%	1,20%	13,55%
Itau High Grade RF Cred Priv Fc	R\$ 145.075.143,47	R\$ 146.779.351,67	0,13%	0,01%	0,00	13,46%	1,17%	13,46%
TOTAL - art. 7º, inciso V, "b"	R\$ 656.916.246,34	R\$ 664.672.632,06						

Quadro 1.

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

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso I, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	dez/22	2022
						RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Ações Valor FICFIA	R\$ 121.536.411,35	R\$ 118.527.546,61	20,34%	2,10%	-5,25	-3,47%	-2,48%	-3,47%
Bradesco FIA Mid Small Caps	R\$ 115.281.869,23	R\$ 112.267.636,26	26,31%	2,71%	-8,55	-8,25%	-2,61%	-8,25%
BTG Pactual Absolut Institucional Fc FIA	R\$ 191.658.193,83	R\$ 185.786.482,44	23,47%	2,42%	-8,88	-4,67%	-3,06%	-4,67%
Icatu Vanguarda Dividendos FIA	R\$ 83.352.591,58	R\$ 81.311.552,03	19,20%	1,98%	-20,09	5,34%	-2,45%	5,34%
Itau Acoes Dunamis Fc	R\$ 132.878.256,90	R\$ 93.874.541,89	20,51%	2,12%	-16,21	5,16%	1,80%	5,16%
Itau Small Cap Valuation Fc Acoes	R\$ 71.031.977,10	R\$ 69.154.719,11	24,30%	2,51%	-9,93	-9,45%	-2,64%	-9,45%
Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	R\$ 71.638.184,39	R\$ 70.345.239,26	19,28%	1,99%	-5,34	-8,00%	-1,80%	-8,00%
Occam Fc de FIA	R\$ 122.401.485,27	R\$ 119.142.731,56	19,57%	2,02%	-17,91	4,52%	-2,66%	4,52%
Vinci Mosaico Institucional FIA	R\$ 98.012.441,82	R\$ 93.214.497,15	23,29%	2,40%	-6,69	-4,56%	-4,90%	-4,56%
Vinci Selection Equities FIA	R\$ 42.066.541,94	R\$ 40.709.417,60	19,05%	1,97%	-15,19	0,18%	-3,23%	0,18%
Brasil Capital Rp Inst Fc de FIA	R\$ 44.960.253,60	R\$ 43.715.099,18	22,81%	2,36%	-7,73	-6,96%	-2,77%	-6,96%
Daycoval Ibovespa Ativo FIA	R\$ 18.736.327,27	R\$ 18.352.468,46	21,35%	2,20%	-5,54	6,44%	-2,05%	6,44%
Cx FIC FIA BR Acoes Livre Quantitativo	R\$ 32.640.961,97	R\$ 31.831.747,06	19,16%	1,98%	-12,99	2,47%	-2,48%	2,47%
Guepardo Institucional FIC FIA	R\$ 80.733.998,58	R\$ 78.742.664,68	22,81%	2,36%	-17,19	4,96%	-2,47%	4,96%
Trigono Flagship Institucional Fc de FIA	R\$ 50.177.516,95	R\$ 49.506.181,90	22,49%	2,32%	-20,25	5,44%	-1,27%	5,44%
Tarpon Gt Institucional Fc FIA	R\$ 71.532.696,03	R\$ 68.123.567,30	21,43%	2,21%	-20,62	14,80%	-4,77%	14,80%
4um Small Caps FIA	R\$ 40.403.117,17	R\$ 39.787.362,84	25,63%	2,64%	-17,23	-11,84%	-1,52%	-11,84%
BB Acoes Selecao Fatorial Fc FI	R\$ 51.078.076,69	R\$ 49.767.266,24	21,00%	2,17%	-5,19	-0,75%	-2,57%	-0,75%
Trigono Delphos Income Inst Fc de FIA	R\$ 4.885.507,22	R\$ 4.750.832,68	23,56%	2,43%	-20,72	14,08%	-2,67%	14,08%
4um Marlin Dividendos FIA	R\$ 4.242.524,53	R\$ 4.182.085,85	18,38%	1,90%	-13,33	4,39%	-1,42%	4,39%
Constancia Fundamento FIA	R\$ 41.347.694,94	R\$ 40.039.781,67	19,19%	1,98%	-14,26	2,07%	-3,17%	2,07%
Claritas Valor Feeder Fc FIA	R\$ 14.448.765,99	R\$ 14.109.109,63	21,92%	2,26%	-17,54	8,32%	-2,35%	8,32%
ARX Income Inst Fc FIA	R\$ 68.424.189,26	R\$ 66.723.073,47	20,48%	2,11%	-5,56	-2,00%	-2,49%	-2,00%
TOTAL - art. 8º, inciso I, "a"	R\$ 1.573.469.583,61	R\$ 1.493.965.604,87						

Quadro 2.

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

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjKzNjE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

						12M	dez/22	2022
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Mult Global Select Equity Ie FI	R\$ 47.431.727,99	R\$ 47.028.246,43	25,48%	2,64%	0,00	-19,25%	-0,85%	-19,25%
Sant Global Equi Dolar Mas Mult Ie Fc FI	R\$ 45.771.735,48	R\$ 44.790.174,49	22,02%	2,28%	0,00	-25,55%	-2,14%	-25,55%
Schroder Sustentabilidade Ações Globais Usd FICFIA	R\$ 25.010.046,68	R\$ 25.059.710,90	25,86%	2,68%	0,00	-22,26%	0,20%	-22,26%
Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	R\$ 13.796.522,63	R\$ 12.838.980,43	58,54%	6,08%	0,00	-62,70%	-6,94%	-62,70%
Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	R\$ 32.241.790,80	R\$ 32.447.139,23	26,05%	2,70%	0,00	-21,61%	0,64%	-21,61%
TOTAL - art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 164.251.823,58	R\$ 162.164.251,48						
						12M	dez/22	2022
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Acoes Esg Is FIA - Bdr Nível I	R\$ 59.530.145,18	R\$ 56.680.008,07	25,27%	2,62%	0,00	-25,15%	-4,79%	-25,15%
Itau Bdr Nível 1 Acoes Fc	R\$ 37.117.636,77	R\$ 35.734.854,74	23,07%	2,40%	0,00	-15,03%	-3,73%	-15,03%
Safira Consumo Americano FIA Bdr Nível I	R\$ 46.206.100,77	R\$ 44.048.915,69	26,70%	2,77%	0,00	-30,39%	-4,67%	-30,39%
TOTAL - TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 142.853.882,72	R\$ 136.463.778,50						
						12M	dez/22	2022
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS TOTAL art 10º, I, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
Safira S&P Reais Pb Fc FI Mult	R\$ 33.222.136,02	R\$ 31.624.240,40	23,87%	2,46%	-0,14	-11,92%	-4,81%	-11,92%
BTG Pactual S&P 500 Br FI Mult	R\$ 34.482.248,57	R\$ 32.804.508,60	23,91%	2,47%	-0,14	-7,99%	-4,87%	-7,99%
Itau Private Mult S&P500 Br Fc	R\$ 157.793,15	R\$ 150.198,45	24,07%	2,48%	-0,14	-11,92%	-4,81%	-11,92%
Cx Fc Cap Prot Bolsa de Valores IV Mult	R\$ 15.540.161,04	R\$ 15.383.696,84	10,46%	1,13%	-1,54		-1,01%	
Cx Fc Cap Prot Bols de Valores V Mult LP	R\$ 16.648.298,98	R\$ 17.081.845,43			-5,71		2,60%	
Rio Bravo Protecao II FI Mult	R\$ 10.343.379,54	R\$ 10.287.728,13			0,00		-0,54%	
Rio Bravo Protecao FI Mult	R\$ 15.342.706,86	R\$ 15.325.287,61	6,58%	0,68%	-5,79		-0,11%	
TOTAL - art. 10º, inciso I, "a"	R\$ 125.736.724,16	R\$ 122.657.505,46						
						12M	dez/22	2022
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS TOTAL art 10º, I, "b"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
BTG Pactual Economia Real FI Partic Mult	R\$ 35.256.952,00	R\$ 35.218.329,99			-1,46	57,81%	-0,11%	57,81%
Kinea P e V Feede Inst I FIP Mult	R\$ 16.223.398,60	R\$ 15.993.362,43			-12,35		-1,42%	
Vinci Strategic Partners I FIP Mult Cl A	R\$ 998.994,63	R\$ 1.112.237,95			-19,47		-1,40%	
BTG Pa Inv de Im FI Participac Mult Cl A	R\$ 12.361.498,37	R\$ 19.233.118,99			-1,68	5,80%	-0,85%	5,80%
TOTAL - art. 10º, inciso I, "b"	R\$ 64.840.843,60	R\$ 71.557.049,36						

Quadro 3.

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

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

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

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



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

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.

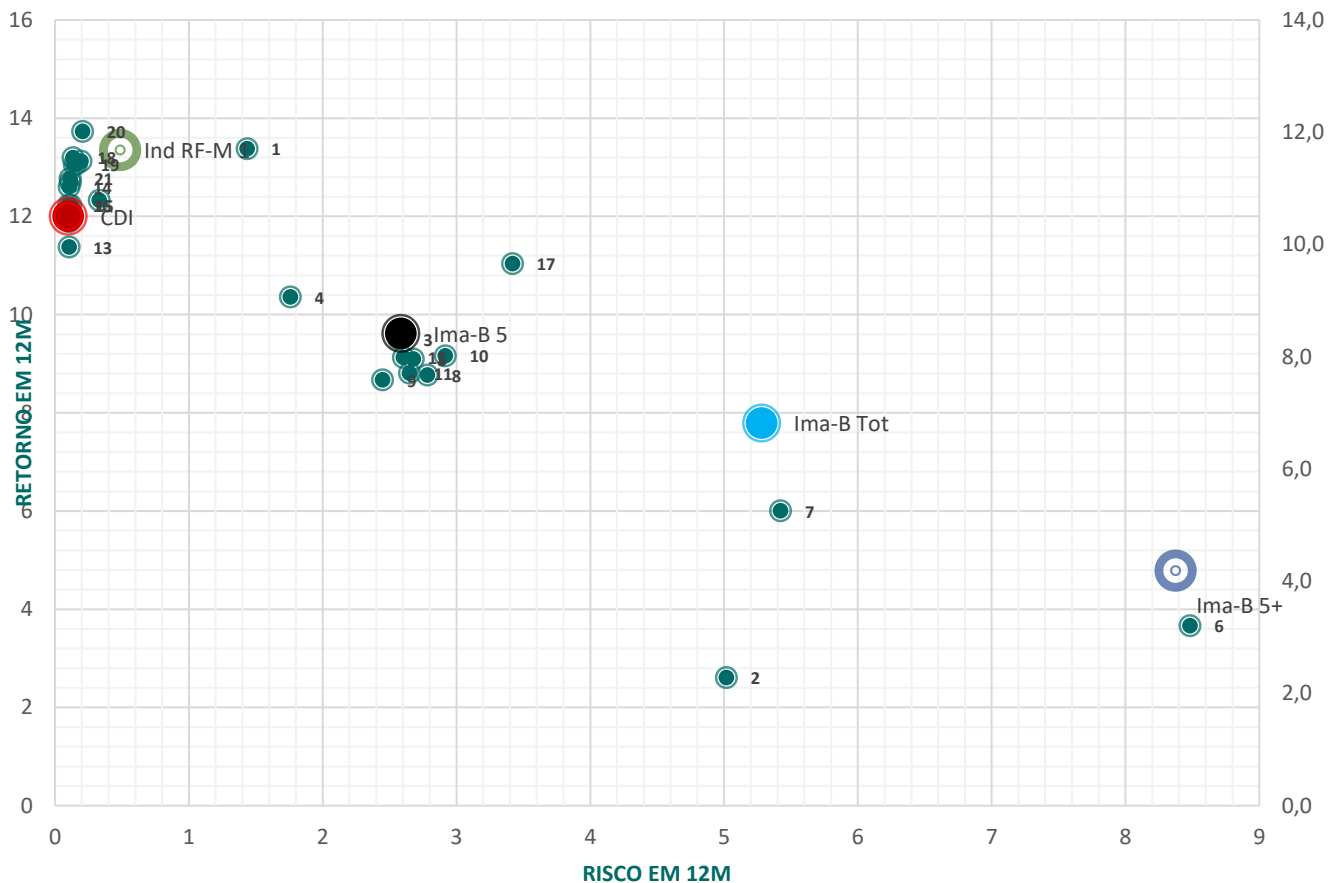


Gráfico 1: Art. 7º Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

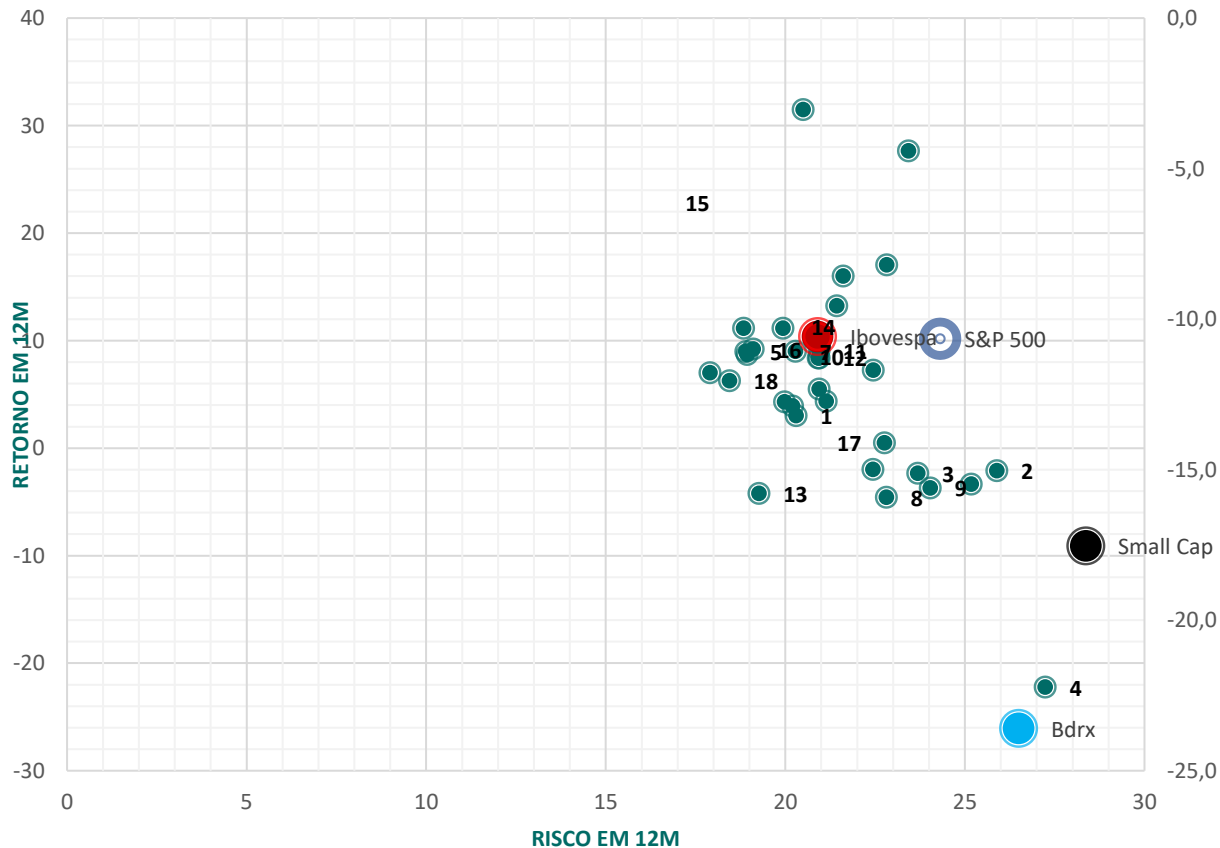
Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art. 7º, inciso I, "b"	BB Prev RF Tit Publ VII FI	13,38	1,44	D+000	D+000
2	art. 7º, inciso I, "b"	Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	2,61	5,02	D+000	D+000
3	art. 7º, inciso I, "b"	FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	9,50	2,57	D+000	D+000
4	art. 7º, inciso I, "b"	Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	10,36	1,76	D+000	D+000
5	-	Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	9,09	2,68	D+000	D+001
6	-	Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	3,66	8,48	D+000	D+001
7	-	Safra Ima Institucional Fc FI RF	6,00	5,42	D+003	D+004
8	art. 7º, inciso I, "b"	BB Prev RF Idka 2 FI	8,77	2,79	D+001	D+001
9	art. 7º, inciso I, "b"	BB Prev RF Alocacao Ativa FcFI	8,67	2,45	D+003	D+003
10	art. 7º, inciso I, "b"	Itau Instit Alocacao Dinamica RF FICFI	9,16	2,92	D+000	D+001
11	art. 7º, inciso III, "a"	Bradesco Fc FI RF Alocacao Dinamica	8,81	2,65	D+003	D+004
12	art. 7º, inciso III, "a"	Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	9,12	2,60	D+001	D+001
13	art. 7º, inciso III, "a"	Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	11,37	0,11	D+000	D+000
14	art. 7º, inciso III, "a"	Bradesco FI RF Ref DI Premium	12,60	0,11	D+000	D+000
15	art. 7º, inciso III, "a"	Caixa FI Brasil RF Ref DI LP	12,23	0,12	D+000	D+000
16	art. 7º, inciso III, "a"	BB Prev RF Ref DI LP Perfil Fc	12,23	0,10	D+000	D+000
17	art. 7º, inciso V, "b"	Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	11,04	3,42	D+005	D+006
18	art. 7º, inciso V, "b"	Mag Cred Priv FI RF LP	13,19	0,14	D+000	D+001
19	art. 7º, inciso V, "b"	Sant RF Cred Priv Crescimento Inst FI LP	13,06	0,16	D+000	D+001
20	art. 7º, inciso V, "b"	BTG Pact Cre Cor I Fc FI RF Cred Priv LP	13,72	0,21	D+030	D+031
21	art. 7º, inciso V, "b"	Porto Seguro FI RF Refer DI Cred Priv	12,77	0,11	D+000	D+000
22	art. 7º, inciso V, "b"	Itau High Grade RF Cred Priv Fc	13,05	0,15	D+000	D+000
23	art. 7º, inciso III, "a"	Itau Soberano RF Simples Fc	11,96	0,10	D+000	D+000
24	art. 7º, inciso I, "b"	Safra Sob Reg Proprio Fc FI RF Ref DI	11,89	0,11	D+000	D+000
25	art. 7º, inciso III, "a"	Icatu Vanguarda RF FI Plus LP	12,33	0,33	D+000	D+001
26	art. 7º, inciso V, "b"	Bnpp Match DI FI RF Ref Cred Priv	12,70	0,12	D+000	D+000
27	art. 7º, inciso V, "b"	Rio Bravo Cred Priv FI RF	13,12	0,20	D+000	D+001

Quadro 4. Legenda Gráfico 1.



Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

Gráfico 2: Art. 8º Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Código	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art. 8º, inciso I, "a"	BB Ações Valor FICFIA	458236<BraNa>	3,02	20,30	D+030	D+032
2	art. 8º, inciso I, "a"	Bradesco FIA Mid Small Caps	131679<BraNa>	-2,12	25,90	D+001	D+003
3	art. 8º, inciso I, "a"	BTG Pactual Absolut Institucional Fc FIA	252311<BraNa>	-2,34	23,69	D+030	D+032
4	art. 8º, inciso I, "a"	Caixa FIA Consumo	302198<BraNa>	-22,23	27,24	D+001	D+003
5	art. 8º, inciso I, "a"	Icatu Vanguarda Dividendos FIA	173126<BraNa>	8,98	18,90	D+001	D+003
6	art. 8º, inciso I, "a"	Itau Acoes Dunamis Fc	423701<BraNa>	4,31	19,98	D+021	D+023
7	art. 8º, inciso I, "a"	Itau Fof Rpi Acoes Ibovespa Ativo Fc	208507<BraNa>	8,99	20,29	D+002	D+004
8	art. 8º, inciso I, "a"	Itau Institucional Acoes Phoenix Fc	424838<BraNa>	-4,58	22,82	D+021	D+023
9	art. 8º, inciso I, "a"	Itau Small Cap Valuation Fc Acoes	025127<BraNa>	-3,72	24,04	D+001	D+003
10	art. 8º, inciso I, "a"	Sant Seleccion Cresc Senior Acoes Fc FI	053872<BraNa>	8,37	20,95	D+001	D+003
11	art. 8º, inciso I, "a"	Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes	055840<BraNa>	9,10	20,95	D+001	D+003
12	art. 8º, inciso I, "a"	Sant Seleccion Crescimento Acoes Fc FI	464066<BraNa>	8,38	20,92	D+027	D+029
13	art. 8º, inciso I, "a"	Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	520772<BraNa>	-4,23	19,27	D+027	D+029
14	art. 8º, inciso I, "a"	Occam Fc de FIA	378100<BraNa>	11,13	19,94	D+001	D+003
15	art. 8º, inciso I, "a"	Sul America Equities FIA	255173<BraNa>	4,37	21,14	D+001	D+003
16	art. 8º, inciso I, "a"	BTG Pactual Dividendos FIC FIA	206032<BraNa>	9,20	19,11	D+001	D+003
17	art. 8º, inciso I, "a"	Vinci Mosaico Institucional FIA	453099<BraNa>	0,47	22,76	D+001	D+003
18	art. 8º, inciso I, "a"	Vinci Selection Equities FIA	320196<BraNa>	6,27	18,45	D+060	D+062
19	art. 8º, inciso I, "a"	Brasil Capital Rp Inst Fc de FIA	586013<BraNa>	-1,99	22,45	D+030	D+032
20	art. 8º, inciso I, "a"	Bnpp Action Fc FIA	287393<BraNa>	10,40	20,79	D+027	D+029
21	art. 8º, inciso I, "a"	Daycoval Ibovespa Ativo FIA	289140<BraNa>	13,22	21,43	D+012	D+014
22	art. 8º, inciso I, "a"	Cx FIC FIA BR Acoes Livre Quantitativo	503452<BraNa>	11,15	18,84	D+013	D+015
23	art. 8º, inciso I, "a"	Guepardo Institucional FIC FIA	214019<BraNa>	7,24	22,45	D+030	D+032
24	art. 8º, inciso I, "a"	Trigono Flagship Institucional Fc de FIA	539961<BraNa>	17,05	22,82	D+030	D+032
25	art. 8º, inciso I, "a"	Tarpon Gt Institucional Fc FIA	522775<BraNa>	31,49	20,50	D+030	D+032
26	art. 8º, inciso I, "a"	4um Small Caps FIA	213691<BraNa>	-3,36	25,18	D+017	D+020
27	art. 8º, inciso I, "a"	BB Acoes Seleccion Fatorial Fc FI	155942<BraNa>	5,49	20,94	D+001	D+003
28	art. 8º, inciso I, "a"	Trigono Delphos Income Inst Fc de FIA	603783<BraNa>	27,64	23,44	D+030	D+032
29	art. 8º, inciso I, "a"	4um Marlin Dividendos FIA	213705<BraNa>	7,00	17,91	D+001	D+004
30	art. 8º, inciso I, "a"	Constancia Fundamento FIA	236942<BraNa>	8,71	18,94	D+014	D+015
31	art. 8º, inciso I, "a"	ARX Income Inst Fc FIA	561371<BraNa>	3,91	20,21	D+001	D+003
32	art. 8º, inciso I, "a"	Claritas Valor Feeder Fc FIA	245755<BraNa>	15,99	21,62	D+031	D+033

Quadro 5. Legenda Gráfico 2.

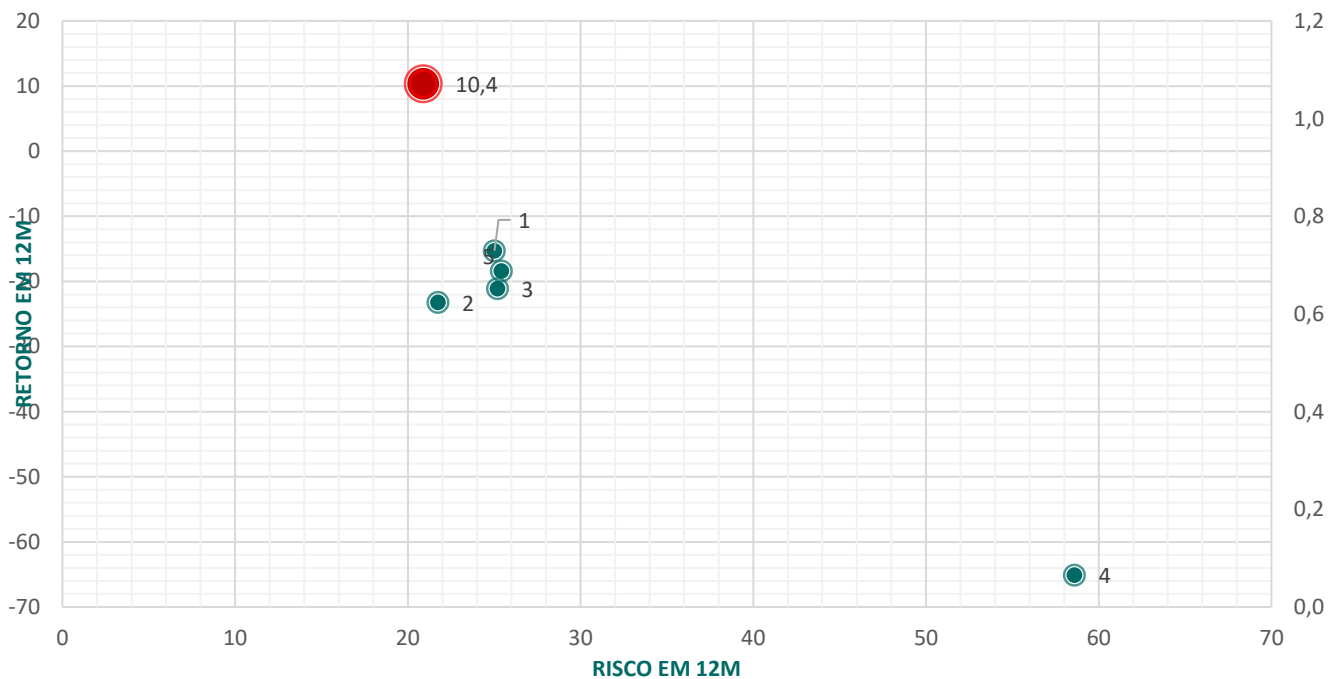


Gráfico 3: Art. 9-A-IIº Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	BB Mult Global Select Equity Ie FI	-15,30	25,02	D+001	D+005
2	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Sant Global Equi Dolar Mas Mult Ie Fc FI	-23,25	21,76	D+001	D+008
3	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	-21,14	25,20	D+001	D+004
4	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	-65,11	58,61	D+001	D+006
5	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	-18,42	25,43	D+001	D+006

Quadro 6. Legenda Gráfico 3.

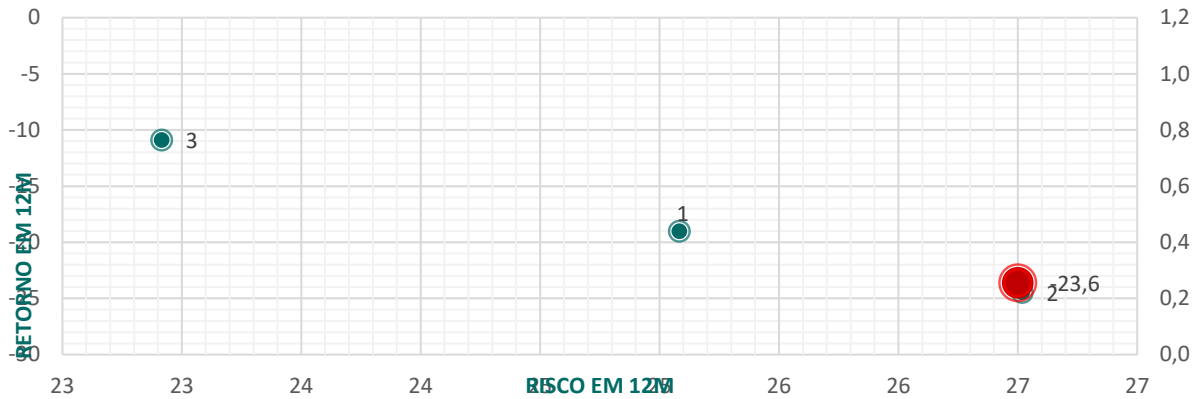


Gráfico 4: Art. 9-A-IIIº Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art 9º - A - III - BDR Nível I	BB Acoes Esg Is FIA -Bdr Nível I	-19,03	25,08	D+001	D+004
2	art 9º - A - III - BDR Nível I	Safra Consumo Americano FIA Bdr Nível I	-24,46	26,52	D+001	D+004
3	art 9º - A - III - BDR Nível I	Itau Acoes Bdr Nível I Fc	-10,90	22,92	D+001	D+003

Quadro 7. Legenda Gráfico 4.

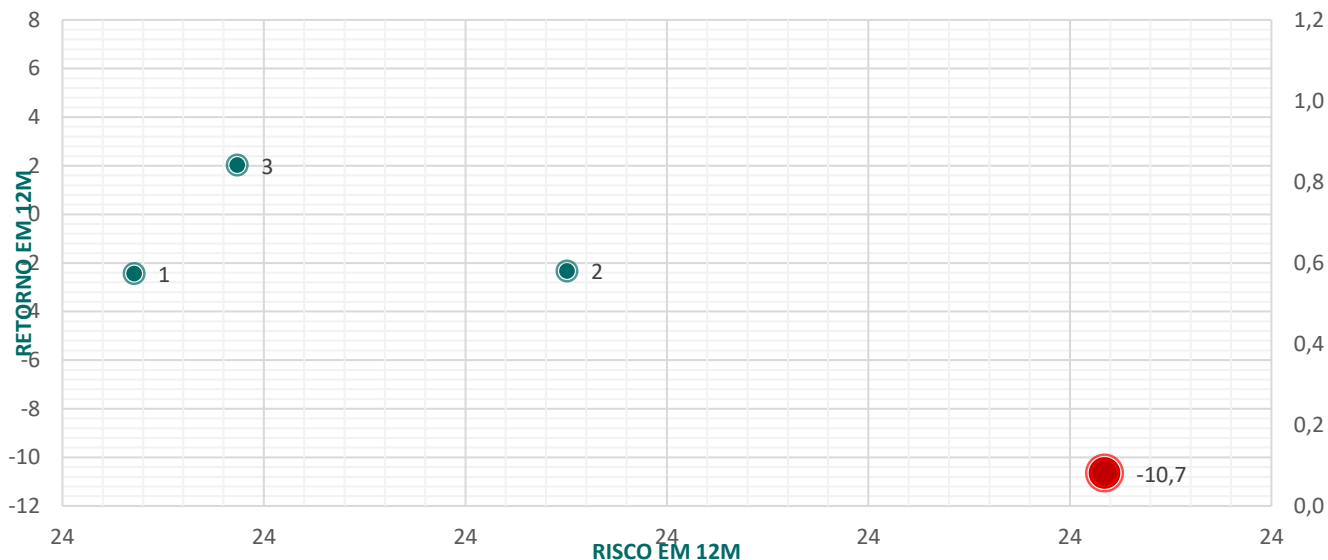


Gráfico 5: Art. 10º Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art. 10º, inciso I, "a"	Safra S&P Reais Pb Fc FI Mult	-2,45	23,84	D+001	D+002
2	art. 10º, inciso I, "a"	Itau Private Mult S&P500 Brl Fc	-2,34	24,05	D+000	D+001
3	art. 10º, inciso I, "a"	BTG Pactual S&P 500 Brl FI Mult	2,01	23,89	D+000	D+002
4	art. 10º, inciso I, "a"	Cx Fc Cap Prot Bolsa de Valores IV Mult			D+000	D+002
5	art. 10º, inciso I, "a"	Rio Bravo Protecao FI Mult			D+001	D+003
6	art. 10º, inciso I, "a"	Rio Bravo Protecao II FI Mult			D+001	D+003
7	art. 10º, inciso I, "b"	Vinci Strategic Partners I FIP Mult CI A			-	-
8	art. 10º, inciso I, "a"	Cx Fc Cap Prot Bols de Valores V Mult LP			D+000	D+002
9	art. 10º, inciso I, "b"	Kinea P e V Feede Inst I FIP Mult			-	-
10	art. 10º, inciso I, "b"	Vinci Strategic Partners I FIP Mult CI A			-	-
11	art. 10º, inciso I, "b"	BTG Pa Inv de Im FI Participac Mult CI A	6,09		-	-

Quadro 8. Legenda Gráfico 5.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjkzNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Relatório da Carteira da Amazonprev reflete os resultados sobre as decisões de investimentos e alocações deliberadas no exercício de 2022, 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 devidamente autorizadas pela Diretoria, com registro nas Atas de Reunião do Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev.

Manaus – AM, 22 de março de 2023.

(ASSINADO DIGITALMENTE)

Alan Nascimento
Coordenador

(ASSINADO DIGITALMENTE)

Bruno Costa Novo
Secretário

(ASSINADO DIGITALMENTE)

Bruno Barroso
Membro

(ASSINADO DIGITALMENTE)

Leonardo Cavalcanti
Membro

(ASSINADO DIGITALMENTE)

Wellington Guimaraes
Membro

(ASSINADO DIGITALMENTE)

Claudinei Soares
Membro

(ASSINADO DIGITALMENTE)

Marcos Souza
Membro

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 25/04/2023 09:57:12
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 25/04/2023 10:07:18

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 25/04/2023 09:25:22

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 25/04/2023 09:25:42

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 25/04/2023 09:29:17

Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 25/04/2023 09:28:36

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 25/04/2023 09:52:44

Documento assinado eletronicamente 293615/2023

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ

Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>

e valide o código: MjkzNJE1



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

Processo: 2024.A.01437

Destino: DIRAF / PRESI

Assunto: Relatório Anual de Investimentos – Exercício/2023

Data: 23/02/2024

RELATÓRIO Nº. 007/2024/COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos apresenta o **Relatório Anual de Investimentos referente ao exercício/2023**, destacando:

- 1) Cenário econômico externo e interno, **fornecido pela LDB CONSULTORIA**, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (**em anexo**); (páginas 02 a 05);
- 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 06 a 13);
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 14 a 16);
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV(páginas 17 a 19);
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (páginas 20 a 22);
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (páginas 23 a 26)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (páginas 27 a 29);
- 8) Rentabilidade do Fundo Previdenciário - Consolidado – FPREV (páginas 30 a 31);
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro – (páginas 32 a 34);
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 35);
- 11) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 36 a 44);
- 12) Total dos Recursos e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (página 45);

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:23
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:09

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:35
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

1. RETROSPECTIVA 2023

Antes de remontarmos os principais eventos ocorridos durante o ano de 2023, é importante pontuarmos, ainda que de forma resumida, como se deu a dinâmica nos mercados ao final do ano de 2022. A partir daí, apresentaremos a evolução dos mercados ao longo do ano de 2023 e seus desdobramentos, com reflexos no desempenho dos indicadores.

O mercado internacional enfrentou desafios significativos no segundo semestre de 2022, com preocupações contínuas sobre pressões inflacionárias, retração econômica global e aumento dos juros em todo o mundo.

Na Zona do Euro, a crise energética decorrente da guerra na Ucrânia gerou incerteza, levando o Banco Central a adotar uma política monetária mais rigorosa para lidar com o risco inflacionário. Nos Estados Unidos, o ciclo de aumento dos juros continuou devido às surpresas inflacionárias e ao mercado de trabalho aquecido. No entanto, as últimas leituras da inflação foram mais favoráveis, contribuindo para o controle inflacionário e reduzindo o risco de recessão.

Na China, a recuperação econômica foi prejudicada pela política de covid zero, resultando em um crescimento abaixo das expectativas e impactando as bolsas de valores de outras economias. Onde, as preocupações com a fraqueza econômica e os sinais de instabilidade social levaram ao fim da política de covid zero, devido às restrições de mobilidade impostas.

Nesse contexto, os principais indicadores do mercado internacional fecharam o ano em território negativo. Assim os índices como MSCI ACWI e S&P 500, em moeda original, respectivamente, acumularam rentabilidade negativa de -19,80% e -19,44%. Já, esses mesmos índices incluindo a variação cambial, respectivamente, renderam -25,01% e -24,68%.

Já, no cenário nacional, houve preocupações com a inflação e incertezas fiscais, especialmente em meio a um contexto eleitoral. Onde, mesmo com a inflação pendendo para certa estabilidade, havia possibilidade de os estímulos fiscais agirem em contramão aos objetivos da política econômica vigente, ocasionando em mais altas de juros.

Sobre o contexto eleitoral, o resultado das eleições definiu um Congresso Nacional mais centrista, enquanto o candidato Lula foi eleito presidente. O que a princípio pode diminuir a chance de grandes desvios na condução de políticas públicas nos próximos anos.

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTg0



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

Além disso, a aprovação da PEC de transição aumentou as dúvidas sobre a consolidação fiscal, permitindo uma ampliação dos gastos em 2023 e a possibilidade de um novo arcabouço fiscal. O novo governo sinalizou uma postura mais intervencionista, enfatizando o papel dos bancos públicos e das empresas estatais no estímulo fiscal.

Sobre as pressões inflacionárias, houve certo alívio com o IPCA desacelerando e mostrando uma tendência mais favorável. No entanto, o PIB do terceiro trimestre registrou uma desaceleração em relação ao primeiro semestre, com perspectivas de continuidade desse desaquecimento devido à política monetária restritiva e ao cenário externo desafiador.

Com relação a taxa de juros, o Banco Central encerrou o ano com a Selic em 13,75%, com estabilização da taxa desde o começo do segundo semestre. Por outro lado, o Copom destacou em suas comunicações os riscos fiscais e seus potenciais efeitos sobre a política monetária.

Nesse contexto, no mercado nacional grande parte dos índices de renda fixa tiveram retorno positivo no ano, com destaque para os mais curtos como IMA-S e CDI que, respectivamente, acumularam retorno de +12,74% e +12,37% ao ano. Já, em relação à renda variável, os índices obtiveram retornos mistos com o Ibovespa e SMLL, respectivamente, com +4,69% e -15,06% no acumulado do ano.

Como veremos adiante, tendo em vista o cenário econômico desafiador de 2023, somente alguns índices do mercado conseguiram superar as metas atuariais, aqui propostas para o estudo, foram representadas pelo IPCA e INPC mais 4,90%, taxa pré-fixada para 2023 pela SPREV, através do Anexo VII da Portaria MTP nº 1.467/22.

O mercado internacional apresentou como um cenário relativamente desafiador, no início do ano, marcado pela preocupação com a inflação, retração econômica global e aumento de juros. Entretanto, com o passar do período, houve uma melhora nas expectativas, impulsionada pela possibilidade no começo do ciclo de redução de juros ocorrer antes do previsto nos EUA, e, além disso, diversos países indicaram uma melhora no controle inflacionário.

No início do ano, ocorreram o colapso de alguns bancos nos EUA e na Europa, o qual chamou a atenção do mercado para os efeitos do aperto monetário que os bancos centrais vêm praticando. A princípio, o receio do surgimento de mais casos de bancos com insuficiência de capital resultou na queda da curva de juros. Entretanto, com o passar do período, ainda no primeiro semestre, aliado às medidas tomadas pelo FED, o estresse financeiro gerado pela crise bancária foi reduzido.

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

Desde o início do ano, ao redor do globo, prevalecia um cenário de resiliência da inflação, em conjunto com uma atividade econômica aquecida, o que gerava uma expectativa de juros em patamares elevados por um período longo. Contudo, no fim do período, houve uma melhora econômica visto que diversos países, com destaque para os desenvolvidos, divulgaram quedas de inflação superiores às expectativas dos seus bancos centrais.

Dessa forma, o cenário externo apresenta uma tendência mais construtiva, com a atividade econômica desacelerando, enquanto o mercado de trabalho ainda se mostra aquecido. Sinalizando que o controle inflacionário está evoluindo de maneira gradual, uma vez que não houve uma desaceleração mais acentuada da atividade econômica.

Nos EUA, apesar do estresse financeiro, gerado pela insolvência dos bancos regionais, às incertezas inflacionárias, e, a uma economia e mercado de trabalho aquecidos no início do ano. No início do segundo semestre, havia uma expectativa do fim do ciclo de elevação das taxas, juntamente com a manutenção das taxas em níveis elevados por algum tempo. No entanto, no fim do ano, os diretores do FED surpreenderam o mercado ao revisarem suas projeções para a taxa básica de juros no curto/médio prazo, indicando três reduções em 2024. Isso reforçou a perspectiva de um cenário positivo para a economia americana.

A China viu melhorias após o fim da política de covid zero, mas enfrentou um desaquecimento econômico mais acentuado do que o previsto, demonstrando sinais de desaceleração no dinamismo de recuperação. Apesar das medidas de estímulo econômico implementadas pelo governo, a economia registrou crescimento abaixo das expectativas, gerando dúvidas sobre a eficácia dessas ações. Assim, prevalece um cenário de cautela.

Olhando para o mercado acionário internacional, os principais índices apresentaram resultado positivo no ano. Onde, o MSCI ACWI e o S&P 500 tiveram retornos de +20,09% e +24,23%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros, sem considerar a variação cambial. Considerando esses mesmos índices, mas, agora sem proteção cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500 subiram +11,43% e +15,27% no acumulado do ano, em conjunto com a desvalorização do Dólar frente ao Real.

No cenário doméstico, ao longo do ano, foi observado uma melhora no cenário devido aos dados de inflação e atividade mais promissores, aliados a uma queda da curva de juros. Adicionalmente, o cenário fiscal foi um tema importante ao longo do período.

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

No fim do primeiro semestre de 2022, o Conselho Monetário Nacional (CMN) revisou as metas de inflação, destacando-se como um dos principais temas do início do ano, visto que uma possível mudança nas metas poderia impactar as expectativas para a inflação. Assim, as metas até 2025 foram mantidas, enquanto a meta para 2026 foi estabelecida em 3,0%.

Já na segunda metade do ano, houve importantes acontecimentos para o cenário fiscal nacional. Iniciado com a aprovação do projeto de Reforma Tributária na Câmara em julho, representando um passo significativo para a melhoria fiscal do país, e no fim do período a parte constitucional da reforma tributária foi aprovada, juntamente com a MP 1.185, peça importante no ajuste fiscal. Contudo, a atenção à política fiscal continuará, pois as discussões em volta desses temas podem ser retomadas em 2024.

Nesse período, o Banco Central passou a adotar um discurso cada vez mais suave, uma vez que quadro inflacionário apresentou uma evolução de forma favorável, com desaceleração nas medidas de núcleo. Já, a atividade começou a apresentar uma trajetória de desaceleração mais clara no fim do ano.

Ao longo do ano, a taxa Selic foi mantida no patamar de 13,75%, até que em agosto de 2023 o Banco Central deu início ao ciclo de redução dos juros básicos até o atual patamar de 11,75%. Além disso, houve a sinalização de que o ritmo de corte de juros deverá ser mantido nas primeiras reuniões de 2024, assim mantendo o processo de flexibilização monetária.

Na renda variável, os índices Ibovespa e SMLL, seguiram a dinâmica dos índices internacionais, apresentando retornos positivos no ano, mesmo com as incertezas locais. Respectivamente, apresentando um retorno de +22,28% e +17,12% no acumulado do ano (Fonte: Relatório de Desempenho de Índices e Indicadores Financeiros em 2023 – LDB Consultoria).

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

2.1 SALDO E PERFORMANCE RENDA FIXA

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	EXERCÍCIO - 2023	
	SALDO (R\$)	RENT. (%)
BB PREVID IDKA 2	R\$ 200.003.445,34	6,33%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 199.608.660,80	6,38%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 99.148.829,82	3,72%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 58.071.814,91	10,80%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 115.087.811,33	4,92%
SAFRA SOBERANO REGIM PROP DI	R\$ 88.986.796,49	12,83%
BRADERSCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 216.906,75	12,39%
ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 53.760.809,24	12,96%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 814.885.074,68	
BRADERSCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 354.000.449,69	11,32%
CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP	R\$ 12.064.705,75	13,32%
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 366.065.155,44	
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 37.003.164,76	11,91%
ITAU HIGH GRADE RF DP FIC FI	R\$ 101.376.703,29	13,93%
BTG PACTUAL CRED CORP FIC FI RF CP	R\$ 101.836.771,59	13,06%
PORTO SEGURO FI REFER DI CRED PRIV	R\$ 102.182.940,09	13,61%
BNP PARIBAS MATCH DI FI RF REF CP	R\$ 107.124.586,03	13,37%
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RF CRED PR	R\$ 135.706.819,91	6,47%
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 585.230.985,67	

Quadro 01

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

2.2 SALDO E PERFORMANCE RENDA VARIÁVEL

FUNDO DE INVESTIMENTO	EXERCÍCIO - 2023	
	SALDO (R\$)	RENT. (%)
TARPON GT INST I FIC FIA	R\$ 93.369.983,99	55,36%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 83.678.439,03	40,60%
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 114.636.052,12	16,67%
BRASIL CAPITAL RP INSTIT FIC AÇÕES	R\$ 38.017.106,21	28,40%
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 47.882.818,57	19,60%
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 115.441.916,75	23,84%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 41.783.111,29	18,61%
OCCAM FIC FIA	R\$ 103.990.021,42	15,73%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 57.931.366,07	11,45%
BB AÇÕES SELEÇÃO FATOR FIC FI	R\$ 59.191.641,58	18,94%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇOES LIVRE QUANT	R\$ 15.725.118,81	27,90%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 16.413.871,65	16,35%
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 94.251.309,53	16,57%
TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 5.546.807,14	16,70%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 78.180.715,30	17,16%
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 80.436.363,26	14,35%
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 116.200.396,89	3,50%
ITAU SMALL CAPS VALUATION	R\$ 79.576.991,78	15,07%
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 45.972.580,68	10,96%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 21.251.092,63	15,80%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 213.963.481,83	15,12%
TOTAL RENDA VARIÁVEL - art. 8º, inciso I	R\$ 1.523.441.186,53	

Quadro 02

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

2.3 SALDO E PERFORMANCE ESTRUTURADO E EXTERIOR

FUNDO DE INVESTIMENTO	EXERCÍCIO - 2023	
	SALDO (R\$)	RENT. (%)
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 34.452.022,68	2,98%
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 17.415.583,10	36,34%
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 48.984.837,96	9,36%
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 28.057.896,57	11,96%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 128.910.340,31	
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	R\$ 66.754.995,87	17,74%
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 30.309.712,28	17,40%
ITAU BDR NÍVEL I AÇÕES FIC	R\$ 33.792.094,90	9,92%
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 130.856.803,05	
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 20.040.508,45	31,04%
FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV FIM	R\$ 17.994.039,86	16,47%
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ 21.430.206,35	25,46%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MM	R\$ 17.729.236,91	15,67%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$ 34.449.505,52	14,51%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MM	R\$ 11.733.921,62	14,06%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 123.377.418,71	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 40.751.339,99	16,28%
BTG PACTUAL INV DE IMPACTO CL A FIP MULT	R\$ 22.704.603,77	8,56%
BTG PACTUAL CLA ECONOMIA R II FIP MULT	R\$ 6.257.563,28	-16,64%
CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$ 2.110.461,07	8,17%
KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$ 26.962.579,28	-6,01%
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP	R\$ 29.971.356,30	1,33%
TOTAL art. 10º, inciso II	R\$ 128.757.903,69	
TOTAL GERAL	R\$ 3.801.524.868,08	

Quadro 03

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

2.4 CARACTERÍSTICA DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

Papel	Vencimento	Taxa	Quantidade	Data de aplicação	Pu da Aplicação	Aplicação Inicial	PU Atual	Saldo
LTN	01/01/2025	14,0800a.a.	13.200,0000	24/11/2022	R\$ 758,01606	R\$ 10.005.811,97	R\$ 875,66	R\$ 11.558.736,80
NTN-B	15/08/2024	IPC-A + 6,9900a.a.	3.429,0000	15/05/2023	R\$ 4.071,74948	R\$ 13.962.028,95	R\$ 4.249,11	R\$ 14.570.203,31
NTN-B	15/08/2024	IPC-A + 5,9080a.a.	8.177,0000	26/05/2022	R\$ 3.970,87392	R\$ 32.469.836,02	R\$ 4.275,65	R\$ 34.961.966,24
NTN-B	15/08/2024	IPC-A + 6,0350a.a.	15.000,0000	31/05/2022	R\$ 3.964,05195	R\$ 59.460.779,31	R\$ 4.272,51	R\$ 64.087.664,81
NTN-B	15/08/2024	IPC-A + 6,9902a.a.	15.976,0000	15/05/2023	R\$ 4.071,73712	R\$ 65.050.072,23	R\$ 4.249,11	R\$ 67.883.738,40
NTN-B	15/08/2024	IPC-A + 5,8310a.a.	24.719,0000	30/05/2022	R\$ 3.979,05855	R\$ 98.358.348,17	R\$ 4.277,55	R\$ 105.736.853,30
NTN-B	15/08/2024	IPC-A + 5,8450a.a.	24.738,0000	27/05/2022	R\$ 3.976,90675	R\$ 98.380.719,23	R\$ 4.277,21	R\$ 105.809.541,20
NTN-B	15/08/2024	IPC-A + 6,0200a.a.	24.798,0000	31/05/2022	R\$ 3.965,22951	R\$ 98.329.761,29	R\$ 4.272,88	R\$ 105.958.852,35
NTN-B	15/08/2024	IPC-A + 6,7000a.a.	25.070,0000	18/11/2022	R\$ 3.928,69610	R\$ 98.492.411,11	R\$ 4.256,18	R\$ 106.702.491,64
NTN-B	15/08/2024	IPC-A + 7,0100a.a.	25.142,0000	24/11/2022	R\$ 3.913,54910	R\$ 98.394.451,50	R\$ 4.248,63	R\$ 106.818.966,00
NTN-B	15/05/2025	IPC-A + 6,2770a.a.	4.300,0000	24/05/2023	R\$ 4.107,22236	R\$ 17.661.056,14	R\$ 4.199,75	R\$ 18.058.921,84
NTN-B	15/05/2025	IPC-A + 5,7700a.a.	8.259,0000	26/05/2022	R\$ 3.987,81969	R\$ 32.935.402,79	R\$ 4.226,41	R\$ 34.905.922,69
NTN-B	15/05/2025	IPC-A + 6,3300a.a.	12.492,0000	03/01/2023	R\$ 3.966,33956	R\$ 49.547.513,82	R\$ 4.196,98	R\$ 52.428.688,30
NTN-B	15/05/2025	IPC-A + 6,2150a.a.	18.665,0000	19/05/2023	R\$ 4.109,01734	R\$ 76.694.808,59	R\$ 4.202,99	R\$ 78.448.884,56
NTN-B	15/05/2025	IPC-A + 6,0530a.a.	20.513,0000	18/05/2023	R\$ 4.120,04859	R\$ 84.514.556,70	R\$ 4.211,49	R\$ 86.390.311,31
NTN-B	15/05/2025	IPC-A + 5,8510a.a.	23.850,0000	06/12/2023	R\$ 4.192,73859	R\$ 99.996.815,32	R\$ 4.222,13	R\$ 100.697.764,25
NTN-B	15/05/2025	IPC-A + 5,8720a.a.	23.875,0000	04/12/2023	R\$ 4.188,48816	R\$ 100.000.154,80	R\$ 4.221,02	R\$ 100.776.861,84
NTN-B	15/08/2026	IPC-A + 6,5830a.a.	10.956,0000	20/12/2022	R\$ 3.916,74891	R\$ 42.911.901,03	R\$ 4.217,92	R\$ 46.211.552,60
NTN-B	15/08/2026	IPC-A + 6,3700a.a.	12.368,0000	04/01/2023	R\$ 3.860,26699	R\$ 47.743.782,08	R\$ 4.238,35	R\$ 52.419.892,94
NTN-B	15/08/2028	IPC-A + 6,3100a.a.	11.295,0000	24/11/2022	R\$ 3.920,11380	R\$ 44.254.164,65	R\$ 4.227,63	R\$ 47.751.095,44
NTN-B	15/08/2030	IPC-A + 6,6000a.a.	42.857,0000	15/01/2014	R\$ 2.230,82077	R\$ 95.606.285,78	R\$ 4.152,78	R\$ 177.975.642,53
NTN-B	15/08/2030	IPC-A + 6,9000a.a.	44.706,0000	29/01/2014	R\$ 2.172,47355	R\$ 97.122.602,48	R\$ 4.090,24	R\$ 182.858.305,29
NTN-B	15/08/2032	IPC-A + 6,4350a.a.	7.600,0000	15/12/2022	R\$ 3.869,50553	R\$ 29.408.241,99	R\$ 4.166,04	R\$ 31.661.922,63
NTN-B	15/08/2032	IPC-A + 5,7600a.a.	8.046,0000	26/05/2022	R\$ 4.037,02148	R\$ 32.481.874,80	R\$ 4.347,33	R\$ 34.978.650,76
NTN-B	15/08/2032	IPC-A + 6,3100a.a.	11.375,0000	24/11/2022	R\$ 3.892,07476	R\$ 44.272.350,37	R\$ 4.198,85	R\$ 47.761.921,58
NTN-B	15/08/2032	IPC-A + 6,3230a.a.	12.345,0000	02/02/2023	R\$ 3.939,37939	R\$ 48.631.638,53	R\$ 4.195,42	R\$ 51.792.477,74
NTN-B	15/05/2033	IPC-A + 6,2900a.a.	12.408,0000	27/02/2023	R\$ 3.957,62562	R\$ 49.106.218,75	R\$ 4.138,72	R\$ 51.353.246,94
NTN-B	15/05/2033	IPC-A + 6,3890a.a.	12.602,0000	02/02/2023	R\$ 3.910,27281	R\$ 49.277.257,97	R\$ 4.111,02	R\$ 51.807.055,34
NTN-B	15/05/2035	IPC-A + 6,1330a.a.	2.437,0000	31/03/2023	R\$ 4.040,47294	R\$ 9.846.632,57	R\$ 4.180,01	R\$ 10.186.680,85
NTN-B	15/05/2035	IPC-A + 6,1230a.a.	3.629,0000	29/03/2023	R\$ 4.040,93467	R\$ 14.664.551,91	R\$ 4.183,28	R\$ 15.181.132,72
NTN-B	15/05/2035	IPC-A + 6,1100a.a.	6.038,0000	30/03/2023	R\$ 4.046,72810	R\$ 24.434.144,25	R\$ 4.187,55	R\$ 25.284.438,51
NTN-B	15/05/2035	IPC-A + 6,0300a.a.	12.427,0000	07/07/2022	R\$ 3.988,81887	R\$ 49.569.052,04	R\$ 4.213,93	R\$ 52.366.542,94
NTN-B	15/05/2035	IPC-A + 6,3800a.a.	12.592,0000	13/02/2023	R\$ 3.906,20923	R\$ 49.186.986,64	R\$ 4.100,12	R\$ 51.628.731,31
NTN-B	15/08/2040	IPC-A + 6,1650a.a.	3.707,0000	30/03/2023	R\$ 4.016,53054	R\$ 14.889.278,69	R\$ 4.217,60	R\$ 15.634.658,52
NTN-B	15/08/2040	IPC-A + 6,2100a.a.	4.956,0000	31/03/2023	R\$ 4.003,32370	R\$ 19.840.472,26	R\$ 4.198,93	R\$ 20.809.916,30
NTN-B	15/08/2040	IPC-A + 6,2130a.a.	6.210,0000	29/03/2023	R\$ 3.995,23437	R\$ 24.810.405,46	R\$ 4.197,70	R\$ 26.067.693,17
NTN-B	15/08/2040	IPC-A + 6,4810a.a.	8.599,0000	03/03/2023	R\$ 3.857,30483	R\$ 33.168.964,23	R\$ 4.088,97	R\$ 35.161.085,85
NTN-B	15/08/2040	IPC-A + 6,3500a.a.	11.496,0000	28/02/2023	R\$ 3.904,68674	R\$ 44.888.278,73	R\$ 4.141,61	R\$ 47.611.902,04
NTN-B	15/08/2040	IPC-A + 6,0350a.a.	12.262,0000	07/07/2022	R\$ 3.985,55651	R\$ 48.870.893,91	R\$ 4.272,19	R\$ 52.385.632,96
NTN-B	15/08/2040	IPC-A + 6,3920a.a.	12.522,0000	10/02/2023	R\$ 3.876,31457	R\$ 48.539.211,05	R\$ 4.124,63	R\$ 51.648.606,77
NTN-B	15/08/2040	IPC-A + 6,4000a.a.	12.533,0000	10/02/2023	R\$ 3.873,12438	R\$ 48.541.867,90	R\$ 4.121,41	R\$ 51.653.572,40
NTN-B	15/08/2040	IPC-A + 6,3800a.a.	12.819,0000	27/02/2023	R\$ 3.891,50309	R\$ 49.885.178,13	R\$ 4.129,47	R\$ 52.935.639,42
NTN-B	15/08/2040	IPC-A + 6,4510a.a.	12.897,0000	01/03/2023	R\$ 3.865,92668	R\$ 49.858.856,40	R\$ 4.100,94	R\$ 52.889.838,37
NTN-B	15/08/2040	IPC-A + 6,1900a.a.	19.937,0000	28/03/2023	R\$ 4.003,38794	R\$ 79.815.545,36	R\$ 4.207,22	R\$ 83.879.292,63
NTN-B	15/08/2040	IPC-A + 6,4990a.a.	25.346,0000	07/02/2023	R\$ 3.831,76332	R\$ 97.119.873,07	R\$ 4.081,82	R\$ 103.457.686,64
NTN-B	15/08/2040	IPC-A + 6,6000a.a.	44.350,0000	15/01/2014	R\$ 2.196,62541	R\$ 97.420.337,07	R\$ 4.041,98	R\$ 179.261.923,02
NTN-B	15/05/2045	IPC-A + 6,1005a.a.	4.800,0000	24/04/2023	R\$ 4.056,34836	R\$ 19.470.472,14	R\$ 4.180,22	R\$ 20.065.044,60
NTN-B	15/05/2045	IPC-A + 6,1076a.a.	19.235,0000	20/04/2023	R\$ 4.051,72767	R\$ 77.934.981,74	R\$ 4.176,81	R\$ 80.340.854,75
TOTAL								R\$ 3.000.819.006,40

Quadro 04

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTg0



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

2.5 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA (R\$)

INSTITUIÇÃO	SALDO (\$)
BRABESCO	R\$ 470.417.753,33
BANCO DO BRASIL	R\$ 440.586.134,91
CAIXA	R\$ 439.982.357,81
ITAÚ	R\$ 425.586.795,10
BTG	R\$ 405.554.268,91
SAFRA	R\$ 255.003.328,68
VINCI	R\$ 159.335.489,11
BNP	R\$ 107.124.586,03
OCCAM	R\$ 103.990.021,42
PORTO	R\$ 102.182.940,09
ICATU	R\$ 94.251.309,53
TARPON	R\$ 93.369.983,99
SANTANDER	R\$ 85.988.002,72
GUEPARDO	R\$ 83.678.439,03
AZ QUEST	R\$ 80.436.363,26
ARX	R\$ 78.180.715,30
RIO BRAVO	R\$ 63.912.664,05
GENIAL/PLURAL	R\$ 51.867.605,78
TRÍGONO	R\$ 51.519.387,82
CONSTANCIA	R\$ 47.882.818,57
BRASIL CAPITAL	R\$ 38.017.106,21
XP/PATRIA	R\$ 29.971.356,30
SCHRODER	R\$ 28.057.896,57
INTRAG/KINEA	R\$ 26.962.579,28
DAYCOVAL	R\$ 21.251.092,63
CLARITAS	R\$ 16.413.871,65
TOTAL	R\$ 3.801.524.868,08

Quadro 05

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

2.6 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA (%)

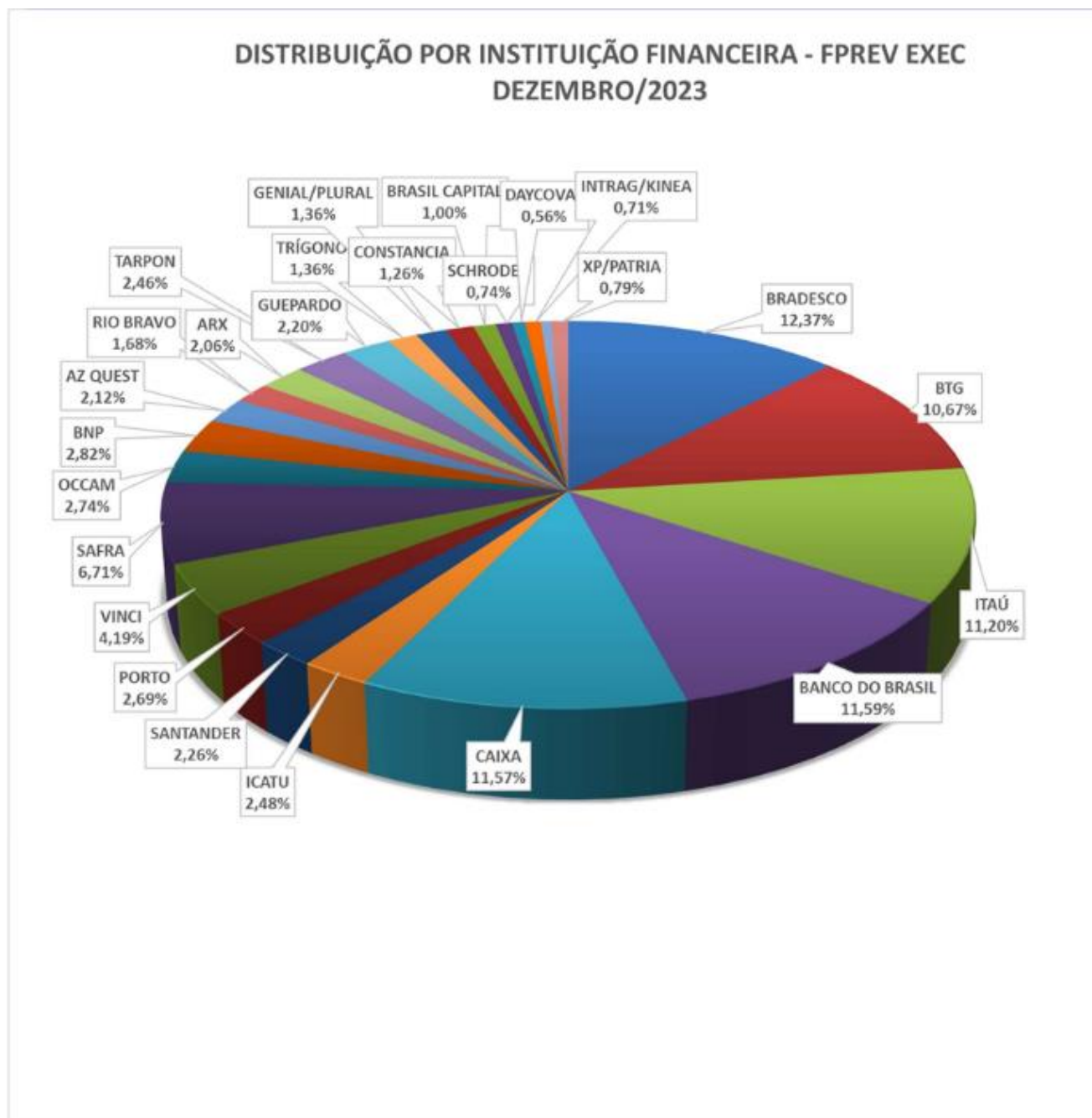


Gráfico 01

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>

e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

2.7 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	EXERCÍCIO - 2023	
	SALDO (\$)	
CVS - A (VENC. 01/01/2027)	R\$	650.739,46
CVS - B (VENC. 01/01/2027)	R\$	4.210.481,35
CVS - C (VENC. 01/01/2027)	R\$	84.415,24
CVS - D (VENC. 01/01/2027)	R\$	461.735,34
TOTAL	R\$	5.407.371,39

Quadro 06

2.8 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS		PRINCIPAL	TOTAL
jan/23	R\$	20.548,63	R\$ 147.749,14	R\$ 168.297,77
fev/23	R\$	20.137,49	R\$ 147.891,88	R\$ 168.029,37
mar/23	R\$	19.756,14	R\$ 148.193,21	R\$ 167.949,35
abr/23	R\$	19.342,87	R\$ 148.335,95	R\$ 167.678,82
mai/23	R\$	18.953,86	R\$ 148.637,28	R\$ 167.591,14
jun/23	R\$	18.556,69	R\$ 148.922,76	R\$ 167.479,45
jul/23	R\$	18.154,01	R\$ 149.208,24	R\$ 167.362,25
ago/23	R\$	17.760,31	R\$ 149.509,57	R\$ 167.269,88
set/23	R\$	17.347,06	R\$ 149.652,31	R\$ 166.999,37
out/23	R\$	16.931,61	R\$ 149.795,05	R\$ 166.726,66
nov/23	R\$	16.510,66	R\$ 149.937,79	R\$ 166.448,45
dez/23	R\$	16.087,63	R\$ 150.080,53	R\$ 166.168,16
TOTAL	R\$	220.086,96	R\$ 1.787.913,71	R\$ 2.008.000,67

Quadro 07

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMÁZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

2.9 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2023			
MÊS	UEA	SEAS	TOTAL
jan/23	R\$ -	R\$ -	R\$ -
fev/23	R\$ -	R\$ 200.728,73	R\$ 200.728,73
mar/23	R\$ 87.271,44	R\$ 100.364,40	R\$ 187.635,84
abr/23	R\$ 43.635,72	R\$ 100.364,40	R\$ 144.000,12
mai/23	R\$ -	R\$ -	R\$ -
jun/23	R\$ 87.271,44	R\$ -	R\$ 87.271,44
jul/23	R\$ -	R\$ -	R\$ -
ago/23	R\$ 43.635,72	R\$ 200.728,80	R\$ 244.364,52
set/23	R\$ -	R\$ -	R\$ -
out/23	R\$ 43.635,72	R\$ -	R\$ 43.635,72
nov/23	R\$ 43.635,72	R\$ -	R\$ 43.635,72
dez/23	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 349.085,76	R\$ 602.186,33	R\$ 951.272,09

Quadro 08

2.10 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	EXERCÍCIO - 2023	
	SALDO (R\$)	% DOS RECURSOS
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 3.801.524.868,08	55,27%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 3.000.819.006,40	43,63%
TÍTULOS CVS	R\$ 5.407.371,39	0,08%
IMÓVEIS	R\$ 69.752.789,32	1,01%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	-	0,00%
TOTAL	R\$ 6.877.504.035,19	100,00%

Quadro 09

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMÁZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

2.11 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

1. Investimentos - Executivo

Saldo dos Investimentos em 12/2022		R\$ 5.780.297.494,50	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2023	R\$ 33.677.075,44	R\$ 13.128.151,27	R\$ 20.548.924,17
02/2023	R\$ 48.396.223,00	R\$ 19.336.309,60	R\$ 29.059.913,40
03/2023	R\$ 47.844.489,27	R\$ 13.501.061,49	R\$ 34.343.427,78
04/2023	R\$ 48.529.359,82	R\$ 12.897.196,53	R\$ 35.632.163,29
05/2023	R\$ 49.523.530,80	R\$ 17.943.389,07	R\$ 31.580.141,73
06/2023	R\$ 48.501.155,60	R\$ 14.660.037,39	R\$ 33.841.118,21
07/2023	R\$ 54.934.340,93	R\$ 13.180.680,80	R\$ 41.753.660,13
08/2023	R\$ 51.193.351,70	R\$ 14.114.289,57	R\$ 37.079.062,13
09/2023	R\$ 51.455.681,82	R\$ 13.840.342,71	R\$ 37.615.339,11
10/2023	R\$ 52.036.725,22	R\$ 19.901.437,80	R\$ 32.135.287,42
11/2023	R\$ 53.367.789,90	R\$ 19.829.408,61	R\$ 33.538.381,29
12/2023	R\$ 129.261.279,80	R\$ 33.285.938,84	R\$ 95.975.340,96
Saldo dos Investimentos em 12/2023		R\$ 6.877.504.035,19	

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	4,6211 %	4,6211 %	0,5600 %
Juros	5,1200 %	5,1200 %	0,4170 %
Meta	9,9777 %	9,9777 %	0,9793 %
Rentabilidade em %	10,6535 %	10,6535 %	1,9854 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 634.103.781,07	R\$ 634.103.781,07	R\$ 132.021.143,08
Resultado em %	+0,6145 %	+0,6145 %	+0,9964 %
Resultado em R\$	R\$ +40.204.415,37	R\$ +40.204.415,37	R\$ +66.902.182,12

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	EXERCÍCIO - 2023	
	SALDO (R\$)	RENT (%)
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 648.022,30	4,92%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 522.402,67	15,83%
SAFRA SOBERANO RP DI FIC REF	R\$ 64.248,86	11,59%
ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 4.083,13	8,46%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 1.238.756,96	
BRADERCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 1.129.200,94	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 1.129.200,94	
BGT PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 1.185.860,72	13,06%
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 1.185.860,72	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 542.587,89	16,57%
BGT ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 1.211.877,86	15,12%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 627.354,11	27,90%
OCCAM FIC FIA	R\$ 1.090.860,86	15,73%
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 131.351,86	28,40%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 3.604.032,58	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 1.081.221,42	17,40%
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 1.081.221,42	
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 552.927,36	32,76%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 552.927,36	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	
TOTAL DOS RECURSOS	R\$ 8.791.999,98	

Quadro 10

3.2 TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

DATA: 29/12/2023

Papel	Data de aplicação	Vencimento	Taxa	Quantidade	Pu da Aplicação	Aplicação Inicial	PU Atual	Saldo Atual
NTN-B	15/01/2014	15/08/2030	IPC-A + 6,6000a.a.	593,00	R\$ 2.230,820771	R\$ 1.322.876,72	R\$ 4.152,778835	R\$ 2.462.597,85
NTN-B	12/07/2022	15/05/2035	IPC-A + 6,2700a.a.	1394,00	R\$ 3.909,502672	R\$ 5.449.846,72	R\$ 4.135,446651	R\$ 5.764.812,63
NTN-B	20/12/2022	15/08/2026	IPC-A + 6,5830a.a.	300,00	R\$ 3.916,748907	R\$ 1.175.024,67	R\$ 4.217,921924	R\$ 1.265.376,58
NTN-B	28/02/2023	15/05/2033	IPC-A + 6,2500a.a.	1,00	R\$ 3.970,416299	R\$ 3.970,42	R\$ 4.149,981433	R\$ 4.149,98
NTN-B	28/02/2023	15/05/2033	IPC-A + 6,2500a.a.	741,00	R\$ 3.970,416299	R\$ 2.942.078,48	R\$ 4.149,981433	R\$ 3.075.136,24
NTN-B	28/03/2023	15/08/2040	IPC-A + 6,1900a.a.	645,00	R\$ 4.003,387940	R\$ 2.582.185,22	R\$ 4.207,217366	R\$ 2.713.655,20
NTN-B	24/04/2023	15/05/2045	IPC-A + 6,1005a.a.	119,00	R\$ 4.056,348362	R\$ 482.705,46	R\$ 4.180,217628	R\$ 497.445,90
NTN-B	18/05/2023	15/05/2025	IPC-A + 6,0530a.a.	66,00	R\$ 4.120,048589	R\$ 271.923,21	R\$ 4.211,490826	R\$ 277.958,39
NTN-B	19/05/2023	15/05/2025	IPC-A + 6,2150a.a.	72,00	R\$ 4.109,017337	R\$ 295.849,25	R\$ 4.202,994083	R\$ 302.615,57

Quadro 11

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTg0



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

3.3 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV ASSEMBLEIA

RECURSOS ALE FPREV	EXERCÍCIO - 2023	
	SALDO (R\$)	
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$	3.553.818,62
FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	R\$	3.604.032,58
FUNDO DE INVESTIMENTOS - EXTERIOR	R\$	1.081.221,42
FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$	552.927,36
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$	16.363.748,34
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$	-
TOTAL	R\$	25.155.748,32

Quadro 12

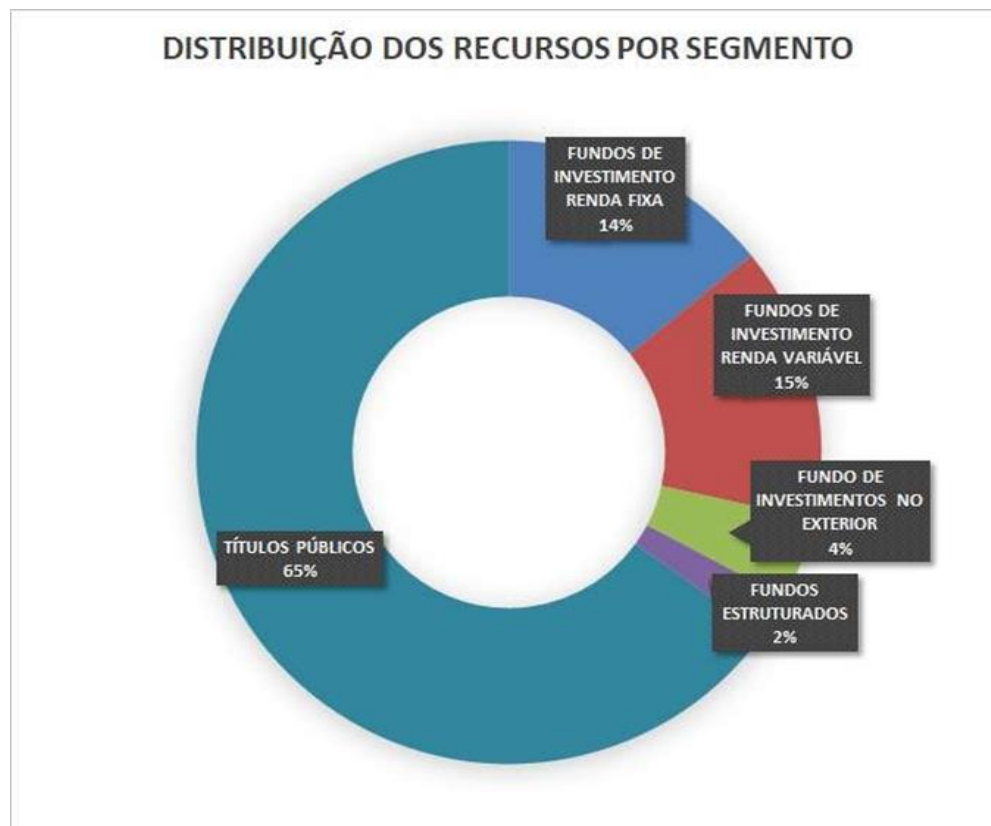


Gráfico 02

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portal.dosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

3.4 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

1. Investimentos - Assembléia

Saldo dos Investimentos em 12/2022				R\$ 20.241.211,49
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)	
01/2023	R\$ 415.713,96	R\$ 50.378,58	R\$ 365.335,38	
02/2023	R\$ 206.662,34	R\$ 10.022,51	R\$ 196.639,83	
03/2023	R\$ 205.889,22	R\$ 10.391,50	R\$ 195.497,72	
04/2023	R\$ 206.002,88	R\$ 12.482,71	R\$ 193.520,17	
05/2023	R\$ 228.539,50	R\$ 11.441,00	R\$ 217.098,50	
06/2023	R\$ 217.377,92	R\$ 11.524,07	R\$ 205.853,85	
07/2023	R\$ 217.377,92	R\$ 10.805,73	R\$ 206.572,19	
08/2023	R\$ 216.019,28	R\$ 11.691,42	R\$ 204.327,86	
09/2023	R\$ 214.375,56	R\$ 11.596,40	R\$ 202.779,16	
10/2023	R\$ 213.182,16	R\$ 11.534,70	R\$ 201.647,46	
11/2023	R\$ 213.182,16	R\$ 11.921,08	R\$ 201.261,08	
12/2023	R\$ 213.182,16	R\$ 11.506,37	R\$ 201.675,79	
Saldo dos Investimentos em 12/2023				R\$ 25.155.748,32

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	4,6211 %	4,6211 %	0,5600 %
Juros	5,1200 %	5,1200 %	0,4170 %
Meta	9,9777 %	9,9777 %	0,9793 %
Rentabilidade em %	10,8121 %	10,8121 %	1,7719 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 2.322.327,84	R\$ 2.322.327,84	R\$ 434.468,11
Resultado em %	+0,7586 %	+0,7586 %	+0,7849 %
Resultado em R\$	R\$ +179.051,15	R\$ +179.051,15	R\$ +194.346,39

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

4. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV MPE/AM

4.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	EXERCÍCIO - 2023	
	SALDO (R\$)	RENT (%)
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 7.419.189,85	4,92%
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 4.321.912,03	7,03%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 11.741.101,88	
BRADESCO RF DI PREMIUM	R\$ 12.075.611,98	8,76%
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 12.075.611,98	
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 23.816.713,86	
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	EXERCÍCIO - 2023	
	SALDO (R\$)	RENT (%)
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC	R\$ 1.549.996,01	28,40%
BB AÇÕES VALOR	R\$ 17.569.633,91	16,67%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 9.671.822,17	40,20%
OCCAM FIC FIA	R\$ 6.977.761,59	15,73%
TARPON GT INST FIC FIA	R\$ 10.569.137,98	55,36%
TRIGONO FLAGSHIP INST FI FIA	R\$ 6.514.035,64	10,96%
TOTAL art. 8º, inciso I - RENDA VARIÁVEL	R\$ 52.852.387,30	
FUNDO DE INVESTIMENTO - ESTRUTURADOS	EXERCÍCIO - 2023	
	SALDO (R\$)	RENT (%)
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 8.820.872,67	32,76%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 8.820.872,67	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	
TOTAL RECURSOS	R\$ 85.489.973,83	

Quadro 13

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

4.2 TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

Papel	Vencimento	Taxa	Quantidade	Data de aplicação	Pu da Aplicação	Aplicação Inicial	PU Atual	Salso (R\$)
NTN-B	15/08/2024	IPC-A +	12.318,00000000	09/06/2022	3.985,18399500	49.089.496,45000000	4.278,09742800	R\$ 52.697.604,12
NTN-B	15/05/2025	IPC-A +	350,00000000	18/05/2023	4.120,04858861	1.442.017,01000000	4.211,49082600	R\$ 1.474.021,79
NTN-B	15/05/2025	IPC-A +	729,00000000	19/05/2023	4.109,01733663	2.995.473,64000000	4.202,99408300	R\$ 3.063.982,69
NTN-B	15/05/2025	IPC-A +	3.022,00000000	13/12/2022	3.949,39413900	11.935.069,09000000	4.193,74467600	R\$ 12.673.496,41
NTN-B	15/08/2026	IPC-A +	12.368,00000000	04/01/2023	3.951,49447096	48.872.083,62000000	4.238,34839400	R\$ 52.419.892,94
NTN-B	15/08/2028	IPC-A +	5.021,00000000	15/12/2022	3.904,80432232	19.606.022,50000000	4.203,81783200	R\$ 21.107.369,33
NTN-B	15/05/2033	IPC-A +	1,00000000	28/02/2023	3.970,41629858	3.970,42000000	4.149,98143300	R\$ 4.149,98
NTN-B	15/05/2033	IPC-A +	2.967,00000000	28/02/2023	3.970,41629858	11.780.225,16000000	4.149,98143300	R\$ 12.312.994,91
NTN-B	15/05/2035	IPC-A +	5.068,00000000	12/07/2022	3.909,50267200	19.813.359,54000000	4.135,44665100	R\$ 20.958.443,63
NTN-B	15/08/2040	IPC-A +	4.320,00000000	03/03/2023	3.857,30483020	16.663.556,87000000	4.088,97381700	R\$ 17.664.366,89
NTN-B	15/05/2045	IPC-A +	845,00000000	24/04/2023	4.056,34836166	3.427.614,37000000	4.180,21762800	R\$ 3.532.283,90
TOTAL								R\$ 197.908.606,59

Quadro 14

4.3 Total dos Recursos – MPE/FPREV

RECURSOS TJ/AM FPREV	EXERCÍCIO - 2023
	SALDO (R\$)
FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	R\$ 23.816.713,86
FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	R\$ 52.852.387,30
FUNDOS ESTRUTURADOS - TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 8.820.872,67
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 197.908.606,59
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	-
TOTAL	R\$ 283.398.580,42

Quadro 15

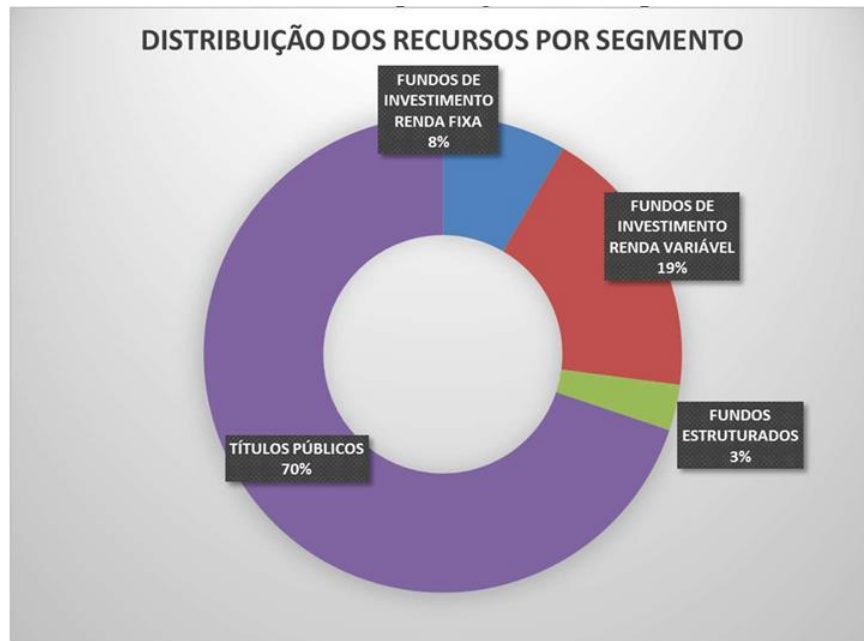


Gráfico 03

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

4.4 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

1. Investimentos - Ministério Público

Saldo dos Investimentos em 12/2022				R\$ 224.915.180,23
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)	
01/2023	R\$ 3.260.425,74	R\$ 136.113,27	R\$ 3.124.312,47	
02/2023	R\$ 1.613.129,15	R\$ 145.358,74	R\$ 1.467.770,41	
03/2023	R\$ 1.623.976,36	R\$ 160.693,65	R\$ 1.463.282,71	
04/2023	R\$ 2.424.596,60	R\$ 178.605,05	R\$ 2.245.991,55	
05/2023	R\$ 2.448.819,76	R\$ 170.907,83	R\$ 2.277.911,93	
06/2023	R\$ 2.450.779,10	R\$ 152.787,06	R\$ 2.297.992,04	
07/2023	R\$ 1.803.152,02	R\$ 144.209,32	R\$ 1.658.942,70	
08/2023	R\$ 1.789.593,08	R\$ 190.978,30	R\$ 1.598.614,78	
09/2023	R\$ 1.799.649,08	R\$ 156.703,67	R\$ 1.642.945,41	
10/2023	R\$ 1.843.142,32	R\$ 192.262,07	R\$ 1.650.880,25	
11/2023	R\$ 2.689.324,32	R\$ 203.346,52	R\$ 2.485.977,80	
12/2023	R\$ 2.767.769,15	R\$ 294.310,84	R\$ 2.473.458,31	
Saldo dos Investimentos em 12/2023				R\$ 283.398.580,41

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	4,6211 %	4,6211 %	0,5600 %
Juros	5,1200 %	5,1200 %	0,4170 %
Meta	9,9777 %	9,9777 %	0,9793 %
Rentabilidade em %	14,4512 %	14,4512 %	2,2696 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 34.095.319,82	R\$ 34.095.319,82	R\$ 6.234.512,38
Resultado em %	+4,0677 %	+4,0677 %	+1,2778 %
Resultado em R\$	R\$ +10.546.931,52	R\$ +10.546.931,52	R\$ +3.544.453,46

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

5. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV DPE/AM

5.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	EXERCÍCIO - 2023	
	SALDO (R\$)	RENT (%)
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGIA	R\$ 5.674.376,69	3,99%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	5.674.376,69	
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 10.028.454,90	6,19%
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 10.028.454,90	
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 15.702.831,59	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	EXERCÍCIO - 2023	
	SALDO (R\$)	RENT (%)
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC	R\$ 1.042.229,94	28,40%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 19.319,64	27,90%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 3.902.480,70	40,20%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 4.964.030,28	
FUNDO ESTRUTURADOS - EXTERIOR	EXERCÍCIO - 2023	
	SALDO (R\$)	RENT (%)
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 4.399.203,15	32,76%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 4.399.203,15	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	
TOTAL RECURSOS	R\$ 25.066.065,02	

Quadro 16

5.2 TOTAL DE TÍTULOS PÚBLICOS

Data Base: 29/12/2023

Papel	Vencimento	Taxa	Quantidade	Data de aplicação	Pu da Aplicação	Aplicação Inicial	PU Atual	Saldo (R\$)
NTN-B	15/05/2025	IPC-A + 6,0530a.a.	349,00000000	18/05/2023	4.120,04858861	1.437.896,96000000	4.211,49082600	R\$ 1.469.810,30
NTN-B	15/05/2025	IPC-A + 6,2150a.a.	1.216,00000000	19/05/2023	4.109,01733663	4.996.565,08000000	4.202,99408300	R\$ 5.110.840,80
NTN-B	15/05/2025	IPC-A + 6,3920a.a.	8.814,00000000	13/12/2022	3.949,39413900	34.809.959,94000000	4.193,74467600	R\$ 36.963.665,57
NTN-B	15/05/2033	IPC-A + 6,2500a.a.	1,00000000	28/02/2023	3.970,41629858	3.970,42000000	4.149,98143300	R\$ 4.149,98
NTN-B	15/05/2033	IPC-A + 6,2500a.a.	493,00000000	28/02/2023	3.970,41629858	1.957.415,24000000	4.149,98143300	R\$ 2.045.940,85
NTN-B	15/05/2035	IPC-A + 6,2700a.a.	2.534,00000000	12/07/2022	3.909,50267200	9.906.679,77000000	4.135,44665100	R\$ 10.479.221,81
NTN-B	15/08/2040	IPC-A + 6,1900a.a.	744,00000000	28/03/2023	4.003,38793991	2.978.520,63000000	4.207,21736600	R\$ 3.130.169,72
TOTAL								R\$ 59.203.799,03

Quadro 17

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

5.3 Total dos Recursos – DPE/FPREV

RECURSOS DPE FPREV	EXERCÍCIO - 2023
	SALDO (R\$)
FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	R\$ 15.702.831,59
FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	R\$ 4.964.030,28
FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 4.399.203,15
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	R\$ 59.203.799,03
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	-
TOTAL	R\$ 84.269.864,05

Quadro 18

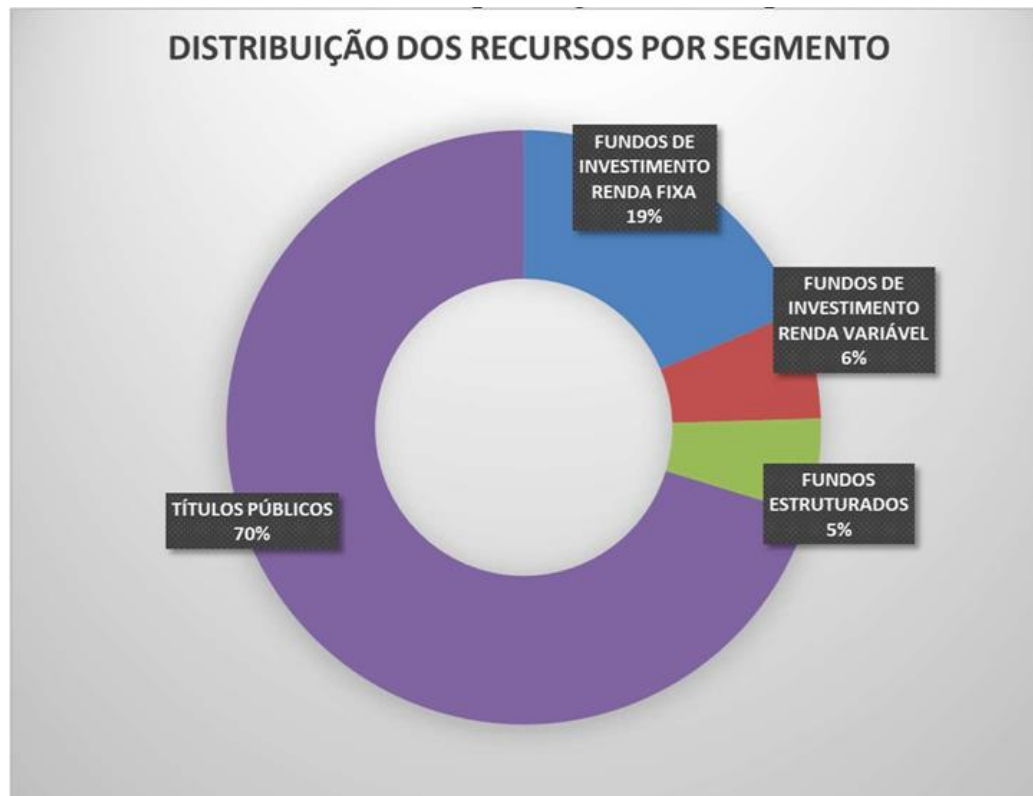


Gráfico 04

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

5.4 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

1. Investimentos - Defensoria

Saldo dos Investimentos em 12/2022			R\$ 56.767.189,87
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2023	R\$ 2.652.384,33	R\$ 41.366,60	R\$ 2.611.017,73
02/2023	R\$ 1.363.583,62	R\$ 191.804,69	R\$ 1.171.778,93
03/2023	R\$ 1.361.693,00	R\$ 121.514,16	R\$ 1.240.178,84
04/2023	R\$ 1.353.367,86	R\$ 107.760,38	R\$ 1.245.607,48
05/2023	R\$ 1.366.665,90	R\$ 172.454,63	R\$ 1.194.211,27
06/2023	R\$ 1.360.589,35	R\$ 122.825,00	R\$ 1.237.764,35
07/2023	R\$ 1.361.041,17	R\$ 106.111,80	R\$ 1.254.929,37
08/2023	R\$ 1.355.445,23	R\$ 119.560,47	R\$ 1.235.884,76
09/2023	R\$ 1.340.191,95	R\$ 108.101,04	R\$ 1.232.090,91
10/2023	R\$ 1.341.254,81	R\$ 135.537,65	R\$ 1.205.717,16
11/2023	R\$ 1.336.714,11	R\$ 121.330,59	R\$ 1.215.383,52
12/2023	R\$ 4.013.536,44	R\$ 152.543,98	R\$ 3.860.992,46
Saldo dos Investimentos em 12/2023			R\$ 84.269.864,05

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	4,6211 %	4,6211 %	0,5600 %
Juros	5,1200 %	5,1200 %	0,4170 %
Meta	9,9777 %	9,9777 %	0,9793 %
Rentabilidade em %	13,6187 %	13,6187 %	1,2453 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 8.797.117,40	R\$ 8.797.117,40	R\$ 988.977,29
Resultado em %	+3,3107 %	+3,3107 %	+0,2634 %
Resultado em R\$	R\$ +2.347.790,02	R\$ +2.347.790,02	R\$ +211.214,28

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTg0



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

6. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV TJ/AM

6.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	EXERCÍCIO - 2023	
	SALDO (R\$)	RENT (%)
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 2.501.705,20	8,99%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 14.852.474,09	3,99%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 17.354.179,29	
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 50.788.693,36	11,32%
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 50.788.693,36	
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 68.142.872,65	
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	EXERCÍCIO - 2023	
	SALDO (R\$)	RENT (%)
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 3.383.175,00	28,40%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 12.171.144,12	27,90%
OCCAM FIC FIA	R\$ 1.244.944,58	15,73%
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 1.358.406,24	10,96%
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.895.932,95	55,36%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 8.501.754,77	40,60%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 5.481.154,76	18,61%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 34.036.512,42	
FUNDO DE INVESTIMENTO - EXTERIOR	EXERCÍCIO - 2023	
	SALDO (R\$)	RENT (%)
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 29.653.224,67	16,01%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 29.653.224,67	
FUNDOS ESTRUTURADOS	EXERCÍCIO - 2023	
	SALDO (R\$)	RENT (%)
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 23.468.199,16	32,76%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 23.468.199,16	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	-	
TOTAL	R\$ 155.300.808,90	

Quadro 19

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

6.2 TOTAL DE TÍTULOS PÚBLICOS

Data Base: 29/12/2023

Papel	Vencimento	Taxa	Quantidade	Data de aplicação	Pu da Aplicação	Aplicação Inicial	PU Atual	Saldo (R\$)
NTN-B	15/08/2024	IPC-A + 6,9900a.a.	4.800,00000000	15/05/2023	4.071,74947582	19.544.397,48000000	4.249,11149300	R\$ 20.395.735,17
NTN-B	15/08/2024	IPC-A + 6,9500a.a.	12.474,00000000	15/12/2022	3.930,24033732	49.025.817,97000000	4.250,08577500	R\$ 53.015.569,96
NTN-B	15/08/2024	IPC-A + 7,3820a.a.	14.916,00000000	26/06/2023	4.069,14501186	60.695.367,00000000	4.239,60701600	R\$ 63.237.978,25
NTN-B	15/08/2024	IPC-A + 7,0700a.a.	24.227,00000000	15/05/2023	4.068,00977782	98.555.672,89000000	4.247,16711000	R\$ 102.896.117,57
NTN-B	15/05/2025	IPC-A + 6,3920a.a.	755,00000000	13/12/2022	3.949,39413900	2.981.792,57000000	4.193,74467600	R\$ 3.166.277,23
NTN-B	15/05/2025	IPC-A + 6,0530a.a.	2.426,00000000	18/05/2023	4.120,04858861	9.995.237,88000000	4.211,49082600	R\$ 10.217.076,74
NTN-B	15/05/2025	IPC-A + 6,2150a.a.	2.426,00000000	19/05/2023	4.109,01733663	9.968.476,06000000	4.202,99408300	R\$ 10.196.463,65
NTN-B	15/05/2025	IPC-A + 6,2770a.a.	20.018,00000000	24/05/2023	4.107,22235876	82.218.377,18000000	4.199,74926400	R\$ 84.070.580,77
NTN-B	15/05/2027	IPC-A + 6,3100a.a.	10.105,00000000	13/12/2022	3.937,02963400	39.783.684,45000000	4.178,11434900	R\$ 42.219.845,50
NTN-B	15/05/2033	IPC-A + 6,2500a.a.	179,00000000	28/02/2023	3.970,41629858	710.704,52000000	4.149,98143300	R\$ 742.846,68
NTN-B	15/05/2033	IPC-A + 6,2500a.a.	3.283,00000000	28/02/2023	3.970,41629858	13.034.876,71000000	4.149,98143300	R\$ 13.624.389,04
NTN-B	15/05/2033	IPC-A + 6,3460a.a.	12.443,00000000	01/03/2023	3.944,39286637	49.080.080,44000000	4.123,01932800	R\$ 51.302.729,50
NTN-B	15/05/2035	IPC-A + 6,1330a.a.	2.400,00000000	31/03/2023	4.040,47294424	9.697.135,07000000	4.180,00855400	R\$ 10.032.020,53
NTN-B	15/05/2035	IPC-A + 6,1230a.a.	2.418,00000000	29/03/2023	4.040,93466921	9.770.980,03000000	4.183,28264400	R\$ 10.115.177,43
NTN-B	15/05/2035	IPC-A + 6,2700a.a.	12.036,00000000	12/07/2022	3.909,50267200	47.054.774,16000000	4.135,44665100	R\$ 49.774.235,89
NTN-B	15/08/2040	IPC-A + 6,3500a.a.	1.277,00000000	28/02/2023	3.904,68673679	4.986.284,96000000	4.141,60595300	R\$ 5.288.830,80
NTN-B	15/08/2040	IPC-A + 6,1650a.a.	2.470,00000000	30/03/2023	4.016,53053509	9.920.830,42000000	4.217,60413200	R\$ 10.417.482,21
NTN-B	15/08/2040	IPC-A + 6,1900a.a.	2.479,00000000	28/03/2023	4.003,38793991	9.924.398,70000000	4.207,21736600	R\$ 10.429.691,85
NTN-B	15/05/2045	IPC-A + 6,1005a.a.	2.400,00000000	24/04/2023	4.056,34836166	9.735.236,07000000	4.180,21762800	R\$ 10.032.522,31
NTN-B	15/05/2045	IPC-A + 6,1076a.a.	2.404,00000000	20/04/2023	4.051,72767050	9.740.353,32000000	4.176,80555000	R\$ 10.041.040,54
TOTAL								R\$ 571.216.611,61

Quadro 20

6.3 Total dos Recursos – DPE/FPREV

RECURSOS TJ/AM FPREV	EXERCÍCIO - 2023
	SALDO (R\$)
FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	R\$ 68.142.872,65
FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	R\$ 34.036.512,42
FUNDO DE INVESTIMENTOS - EXTERIOR	R\$ 29.653.224,67
FUNDO DE INVESTIMENTO - ESTRUTURADOS	R\$ 23.468.199,16
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 571.216.611,61
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	-
TOTAL	R\$ 726.517.420,51

Quadro 21

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
 Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
 Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

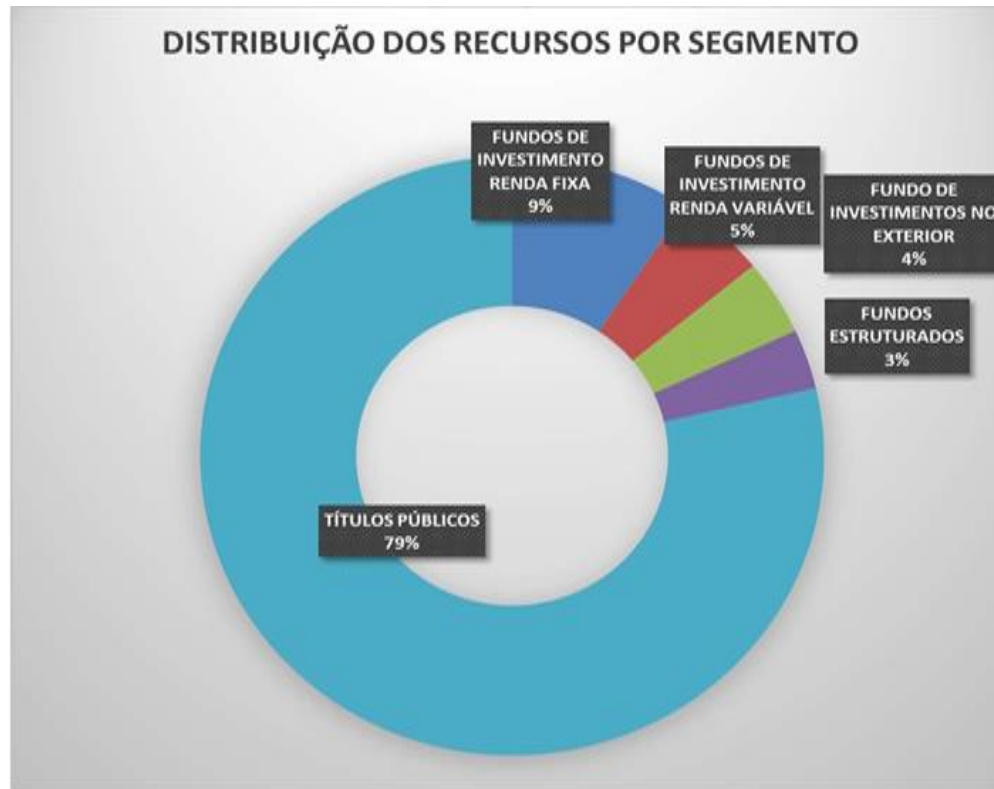


Gráfico 05

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
 Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

6.4 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

1. Investimentos - Tribunal de Justiça

Saldo dos Investimentos em 12/2022		R\$ 593.290.788,68	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2023	R\$ 4.503.689,63	R\$ 316.298,28	R\$ 4.187.391,35
02/2023	R\$ 4.452.062,90	R\$ 386.831,46	R\$ 4.065.231,44
03/2023	R\$ 4.682.824,72	R\$ 954.025,73	R\$ 3.728.798,99
04/2023	R\$ 37.853,98	R\$ 416.120,94	R\$ -378.266,96
05/2023	R\$ 9.514.313,12	R\$ 826.562,19	R\$ 8.687.750,93
06/2023	R\$ 4.768.915,92	R\$ 398.809,96	R\$ 4.370.105,96
07/2023	R\$ 4.785.265,87	R\$ 584.156,10	R\$ 4.201.109,77
08/2023	R\$ 33.609,27	R\$ 678.500,13	R\$ -644.890,86
09/2023	R\$ 9.554.818,39	R\$ 572.787,56	R\$ 8.982.030,83
10/2023	R\$ 4.778.352,07	R\$ 665.888,73	R\$ 4.112.463,34
11/2023	R\$ 4.848.237,81	R\$ 817.855,72	R\$ 4.030.382,09
12/2023	R\$ 10.103.321,49	R\$ 1.033.865,02	R\$ 9.069.456,47
Saldo dos Investimentos em 12/2023		R\$ 726.517.420,51	

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %		Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês	
IPCA (IBGE)	4,6211 %	4,6211 %	0,5600 %	
Juros	5,1200 %	5,1200 %	0,4170 %	
Meta	9,9777 %	9,9777 %	0,9793 %	
Rentabilidade em %	12,8233 %	12,8233 %	1,4042 %	
Rentabilidade em R\$	R\$ 78.815.068,48	R\$ 78.815.068,48	R\$ 9.934.786,54	
Resultado em %	+2,5874 %	+2,5874 %	+0,4208 %	
Resultado em R\$	R\$ +17.479.111,38	R\$ +17.479.111,38	R\$ +3.006.074,51	

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

7. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV TJ/AM

7.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	EXERCÍCIO - 2023	
	SALDO (R\$)	RENT (%)
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 3.854.347,63	3,99%
BRADERCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 3.929.784,29	8,99%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 7.784.131,92	
BRADERCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 6.162.326,16	4,00%
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 6.162.326,16	
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 13.946.458,08	
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	EXERCÍCIO - 2023	
	SALDO (R\$)	RENT (%)
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 914.006,02	28,40%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT.	R\$ 12.171.144,12	27,90%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.969.243,25	40,60%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 1.021.430,93	18,61%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 16.075.824,32	
FUNDO DE INVESTIMENTO - EXTERIOR	EXERCÍCIO - 2023	
	SALDO (R\$)	RENT (%)
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 567.136,03	16,01%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 567.136,03	
FUNDO DE INVESTIMENTO - ESTRUTURADOS	EXERCÍCIO - 2023	
	SALDO (R\$)	RENT (%)
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 4.378.554,32	32,76%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 4.378.554,32	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE		
TOTAL	R\$ 34.967.972,75	

Quadro 22

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

7.2 TOTAL DE TÍTULOS PÚBLICOS

Papel	Vencimento	Taxa	Quantidade	Data de aplicação	Pu da Aplicação	Aplicação Inicial	PU Atual	Saldo (R\$)
NTN-B	15/08/2024	IPC-A +	12.474	15/12/2022	3.930,24033732	49.025.817,9700000	4.250,08577500	R\$ 53.015.569,96
NTN-B	15/05/2025	IPC-A +	562	18/05/2023	4.120,04858861	2.315.467,3100000	4.211,49082600	R\$ 2.366.857,84
NTN-B	15/05/2025	IPC-A +	1.216	19/05/2023	4.109,01733663	4.996.565,0800000	4.202,99408300	R\$ 5.110.840,80
NTN-B	15/05/2027	IPC-A +	2.526	13/12/2022	3.937,02963400	9.944.936,8600000	4.178,11434900	R\$ 10.553.916,85
NTN-B	15/05/2033	IPC-A +	4.699	28/02/2023	3.970,41629858	18.656.986,1900000	4.149,98143300	R\$ 19.500.762,75
NTN-B	15/05/2035	IPC-A +	4.308	12/07/2022	3.909,50267200	16.842.137,5100000	4.135,44665100	R\$ 17.815.504,17
NTN-B	15/05/2035	IPC-A +	7.522	06/03/2023	3.911,49296032	29.422.250,0500000	4.084,83416400	R\$ 30.726.122,58
TOTAL								R\$ 139.089.574,95

Quadro 23

7.3 Total dos Recursos – DPE/FPREV

RECURSOS TCE/AM FPREV	EXERCÍCIO - 2023
	SALDO (R\$)
FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	R\$ 13.946.458,08
FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	R\$ 16.075.824,32
FUNDO DE INVESTIMENTOS - EXTERIOR	R\$ 567.136,03
FUNDO DE INVESTIMENTOS - ESTRUTURADOS	R\$ 4.378.554,32
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 139.089.574,95
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	-
TOTAL	R\$ 174.057.547,70

Quadro 24

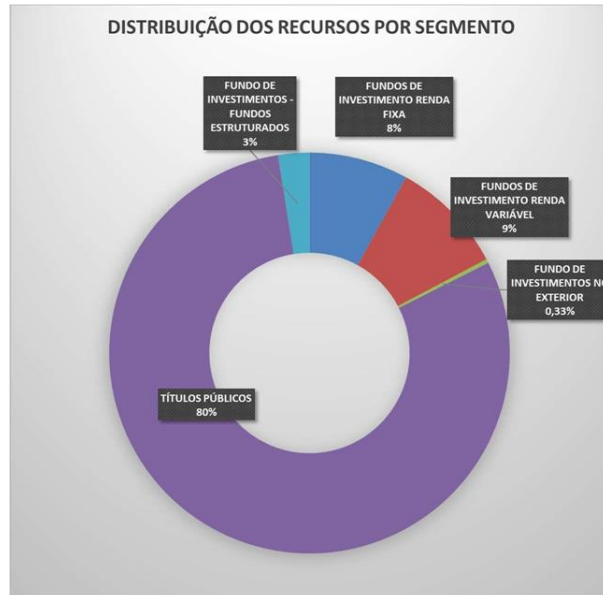


Gráfico 06

7.4 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTg0



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

1. Investimentos - Tribunal de Contas

Saldo dos Investimentos em 12/2022			R\$ 143.242.366,18
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2023	R\$ 818.311,18	R\$ 24.852,01	R\$ 793.459,17
02/2023	R\$ 840.406,80	R\$ 57.209,33	R\$ 783.197,47
03/2023	R\$ 868.020,15	R\$ 119.035,88	R\$ 748.984,27
04/2023	R\$ 884.821,56	R\$ 81.955,68	R\$ 802.865,88
05/2023	R\$ 893.485,01	R\$ 93.218,22	R\$ 800.266,79
06/2023	R\$ 906.009,82	R\$ 92.481,20	R\$ 813.528,62
07/2023	R\$ 1.039.877,59	R\$ 83.329,25	R\$ 956.548,34
08/2023	R\$ 542.924,76	R\$ 85.771,35	R\$ 457.153,41
09/2023	R\$ 1.698.028,43	R\$ 145.941,45	R\$ 1.552.086,98
10/2023	R\$ 605.784,29	R\$ 108.651,95	R\$ 497.132,34
11/2023	R\$ 2.636.610,67	R\$ 220.791,68	R\$ 2.415.818,99
12/2023	R\$ 1.128.314,27	R\$ 187.161,55	R\$ 941.152,72
Saldo dos Investimentos em 12/2023			R\$ 174.057.547,70

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	4,6211 %	4,6211 %	0,5600 %
Juros	5,1200 %	5,1200 %	0,4170 %
Meta	9,9777 %	9,9777 %	0,9793 %
Rentabilidade em %	13,0345 %	13,0345 %	1,5227 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 19.252.986,54	R\$ 19.252.986,54	R\$ 2.596.470,49
Resultado em %	+2,7794 %	+2,7794 %	+0,5381 %
Resultado em R\$	R\$ +4.512.682,00	R\$ +4.512.682,00	R\$ +926.560,32

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTg0



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV

1. Investimentos - CONSOLIDADO

Saldo dos Investimentos em 12/2022				R\$ 6.818.754.230,95
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)	
01/2023	R\$ 45.327.600,28	R\$ 13.697.160,01	R\$ 31.630.440,27	
02/2023	R\$ 56.872.067,81	R\$ 20.127.536,33	R\$ 36.744.531,48	
03/2023	R\$ 56.586.892,72	R\$ 14.866.722,41	R\$ 41.720.170,31	
04/2023	R\$ 53.436.002,70	R\$ 13.694.121,29	R\$ 39.741.881,41	
05/2023	R\$ 63.975.354,09	R\$ 19.217.972,94	R\$ 44.757.381,15	
06/2023	R\$ 58.204.827,71	R\$ 15.438.464,68	R\$ 42.766.363,03	
07/2023	R\$ 64.141.055,50	R\$ 14.109.293,00	R\$ 50.031.762,50	
08/2023	R\$ 55.130.943,32	R\$ 15.200.791,24	R\$ 39.930.152,08	
09/2023	R\$ 66.062.745,23	R\$ 14.835.472,83	R\$ 51.227.272,40	
10/2023	R\$ 60.818.440,87	R\$ 21.015.312,90	R\$ 39.803.127,97	
11/2023	R\$ 65.091.858,97	R\$ 21.204.654,20	R\$ 43.887.204,77	
12/2023	R\$ 147.487.403,31	R\$ 34.965.326,60	R\$ 112.522.076,71	
Saldo dos Investimentos em 12/2023				R\$ 8.170.903.196,18

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %		Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês	
IPCA (IBGE)	4,6211 %	4,6211 %	0,5600 %	
Juros	5,1200 %	5,1200 %	0,4170 %	
Meta	9,9777 %	9,9777 %	0,9793 %	
Rentabilidade em %	11,0480 %	11,0480 %	1,9252 %	
Rentabilidade em R\$	R\$ 777.386.601,15	R\$ 777.386.601,15	R\$ 152.210.357,89	
Resultado em %	+0,9732 %	+0,9732 %	+0,9367 %	
Resultado em R\$	R\$ +75.269.981,44	R\$ +75.269.981,44	R\$ +74.784.831,08	

Nota 1: Os valores de **Receita** referem-se às contribuições previdenciárias recebidas no período. Os valores de **Despesas** referem-se ao pagamento de inativos e pensionistas

Atenciosamente,

Luiz Cláudio Kogut
Atuário - Miba 1.308

Sócio-Gerente da ACTUARIAL Assessoria e Consultoria Atuarial Ltda-Epp.

Observação: Os resultados deste relatório foram gerados automaticamente por software, portanto, algumas vezes problemas podem ocorrer com os resultados. Se notar alguma diferença nos mesmos, entre em contato com a empresa para que os mesmos sejam corrigidos. Este relatório pode conter informações confidenciais e/ou privilegiadas. Se você não for a pessoa autorizada a obtê-la, não pode usar, copiar ou divulgar as informações nela contidas ou tomar qualquer ação baseada nelas. Comunicações pela Internet não podem ser garantidas quanto à segurança ou inexistência de erros ou de vírus. O remetente, por esta razão, não aceita responsabilidade por qualquer erro ou omissão no contexto da mensagem decorrente da transmissão via internet.

ACTUARIAL Assessoria e Consultoria Atuarial Ltda-Epp
R. Comendador Araújo, 143 - Qto 101 - 10º andar CEP 80420-900 Curitiba PR Telefone (41) 3322-2110
actuarial.com.br
CNPJ 00.767.919/0001-05

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portal.dosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

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



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



Atenciosamente,

Luiz Cláudio Kogut
Atuário - Miba 1.308

Sócio-Gerente da ACTUARIAL Assessoria e Consultoria Atuarial Ltda-Epp.

Observação: Os resultados deste relatório foram gerados automaticamente por software, portanto, algumas vezes problemas podem ocorrer com os resultados. Se notar alguma diferença nos mesmos, entre em contato com a empresa para que os mesmos sejam corrigidos. Este relatório pode conter informações confidenciais e/ou privilegiadas. Se você não for a pessoa autorizada a obtê-la, não pode usar, copiar ou divulgar as informações nela contidas ou tomar qualquer ação baseada nelas. Comunicações pela Internet não podem ser garantidas quanto à segurança ou inexistência de erros ou de vírus. O remetente, por esta razão, não aceita responsabilidade por qualquer erro ou omissão no contexto da mensagem documentada da transmissão via internet.

ACTUARIAL Assessoria e Consultoria Atuarial Ltda-Epp
R. Comendador Araújo, 143 - Qto 101 - 10º andar CEP 80420-900 Curitiba PR Telefone (41) 3322-2110
actuarial.com.br
CNPJ 00.767.919/0001-05

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

9. PONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	EXERCÍCIO - 2023
	SALDO (R\$)
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 4.815.612,71
FUNDO BRADESCO RF - COMPREV	R\$ 16.054.205,87
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 8.526,03
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 188.206,66
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 237.972,51
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	-
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - COMPREV	R\$ 12.400,14
TOTAL	R\$ 21.316.923,92

Quadro 25

9.2 Fundo de Proteção Previdenciária dos Militares

DESCRIÇÃO	EXERCÍCIO - 2023
	SALDO (R\$)
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R\$ 19.976.429,43
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA - CORRENTE - FPPM	-
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ 24.263,78
TOTAL	R\$ 20.000.693,21

Quadro 26

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

9.3 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

DESCRIÇÃO	EXERCÍCIO - 2023
	SALDO (R\$)
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 537.952,67
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -
TOTAL	R\$ 537.952,67

Quadro 27

9.4 FFIN - Assembleia Legislativa ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	EXERCÍCIO - 2023
	SALDO (R\$)
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	-
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 2.075,62
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 4.166,74
TOTAL	R\$ 6.242,36

Quadro 28

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGE/MPE-AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	EXERCÍCIO - 2023
	SALDO (R\$)
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 4.698.661,65
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	-
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	-
TOTAL	R\$ 4.698.661,65

Quadro 29

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portal.dosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

9.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	EXERCÍCIO - 2023
	SALDO (R\$)
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 11.773.996,65
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	-
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	-
TOTAL	R\$ 11.773.996,65

Quadro 30

9.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	EXERCÍCIO - 2023
	SALDO (R\$)
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.033.046,10
DISPONIBILIDADE COBERTURA TCE FFIN	-
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	-
TOTAL	R\$ 1.033.046,10
TOTAL GERAL FFIN	R\$ 59.367.516,56

Quadro 31

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Evolução do Saldo de Taxa de Administração

DESCRIÇÃO	EXERCÍCIO - 2023
	SALDO (R\$)
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 3.652.977,79
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 10.352.365,27
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - BRADESCO	-
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - CAIXA ECONÔMICA	R\$ 24.116,34
TOTAL PODER EXECUTIVO	R\$ 14.029.459,40
DESCRIÇÃO	SALDO (R\$)
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	-
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	-
TOTAL - ALE	-
DESCRIÇÃO	SALDO (R\$)
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	-
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	-
TOTAL - TCE	-
DESCRIÇÃO	SALDO (R\$)
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	-
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	-
TOTAL TJ/AM	-
DESCRIÇÃO	SALDO (R\$)
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	-
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	-
TOTAL PGJ/AM	-
TOTAL GERAL	R\$ 14.029.459,40

Quadro 32

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

11. ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS

11.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2023		Resolução CMN nº 4.963/21
			ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE SUPERIOR	
TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL	R\$ 3.984.601.346,91	48,78%	34,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
TOTAL art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 3.984.601.346,91				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 199.608.660,80	11,19%	29,00%	100,00%	art. 7º, Inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 200.003.445,34				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 58.071.814,91				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 147.536.221,89				
SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	R\$ 89.051.045,35				
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 99.671.232,49				
ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 53.764.892,37				
BRABESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 66.072.686,38				
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 913.779.999,53				
BRABESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 441.625.241,79	5,68%	5,00%	70,00%	art. 7º, inciso III, "a"
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 22.417.071,02				
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 464.042.312,81				
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 37.003.164,76	7,18%	10,00%	10,00%	art 7º, inciso V, "b"
ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 101.376.703,29				
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 103.022.632,31				
PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R\$ 102.182.940,09				
BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF	R\$ 107.124.586,03				
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RF CRED PR	R\$ 135.706.819,91				
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 586.416.846,39				
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 5.948.840.505,64	72,83%			

Quadro 33

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

11.2 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Variável

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2023		Resolução CMN nº 4.963/21
			ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE SUPERIOR	
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 78.180.715,30	20,02%	15,00%	44,00%	art. 8º, inciso I
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 80.436.363,26				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 132.205.686,03				
BB SELEÇÃO FATOR FIC FI	R\$ 59.191.641,58				
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 116.200.396,89				
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 45.037.865,04				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 215.175.359,69				
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 40.714.080,80				
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 21.251.092,63				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 94.793.897,42				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 57.931.366,07				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 79.576.991,78				
OCCAM FIC FIA	R\$ 113.303.588,45				
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 115.441.916,75				
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 107.723.739,92				
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 48.285.696,98				
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 53.845.022,56				
TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 105.835.054,92				
TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 5.546.807,14				
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 47.882.818,57				
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 16.413.871,65				
TOTAL art. 8º, inciso I, "a"	R\$ 1.634.973.973,43				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.634.973.973,43	20,02%			

Quadro 34

11.3 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Investimentos no Exterior

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2023		Resolução CMN nº 4.963/21
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 30.220.360,70	1,95%	1,00%	10,00%	art 9º-A, inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 34.452.022,68				
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 17.415.583,10				
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 48.984.837,96				
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 28.057.896,57				
TOTAL art 9º, inciso II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 159.130.701,01				
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 66.754.995,87	1,62%	1,00%		art 9º-A, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 31.390.933,70				
ITAU BDR NIVEL 1 AÇÕES	R\$ 33.792.094,90				
TOTAL art 9º, inciso III - BDR Nível I	R\$ 131.938.024,47				
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 291.068.725,48	3,56%			

Quadro 35

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

11.4 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Fundos Estruturados

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2023		Resolução CMN nº 4.963/21
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 41.619.756,66	2,02%	2,00%	10,00%	art. 10º, inciso I, a
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 20.040.508,45				
FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$ 17.994.039,86				
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ 21.430.206,35				
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM	R\$ 11.733.921,62				
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$ 34.449.505,52				
RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$ 17.729.236,91				
TOTAL art. 10º, inciso I, "a"	R\$ 164.997.175,37				
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 40.751.339,99	1,58%	2,00%	5,00%	art. 10º, inciso I, b
BTG PACTUAL INV DE IMPACTO CL A FIP MULT	R\$ 22.704.603,77				
BTG PACTUAL CLA ECONOMIA REAL II FIP MULT	R\$ 6.257.563,28				
CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$ 2.110.461,07				
KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$ 26.962.579,28				
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP	R\$ 29.971.356,30				
TOTAL art. 10º, inciso I, "b"	R\$ 128.757.903,69				
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 293.755.079,06	3,60 %			
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 8.168.638.283,61	100 %			

Quadro 36

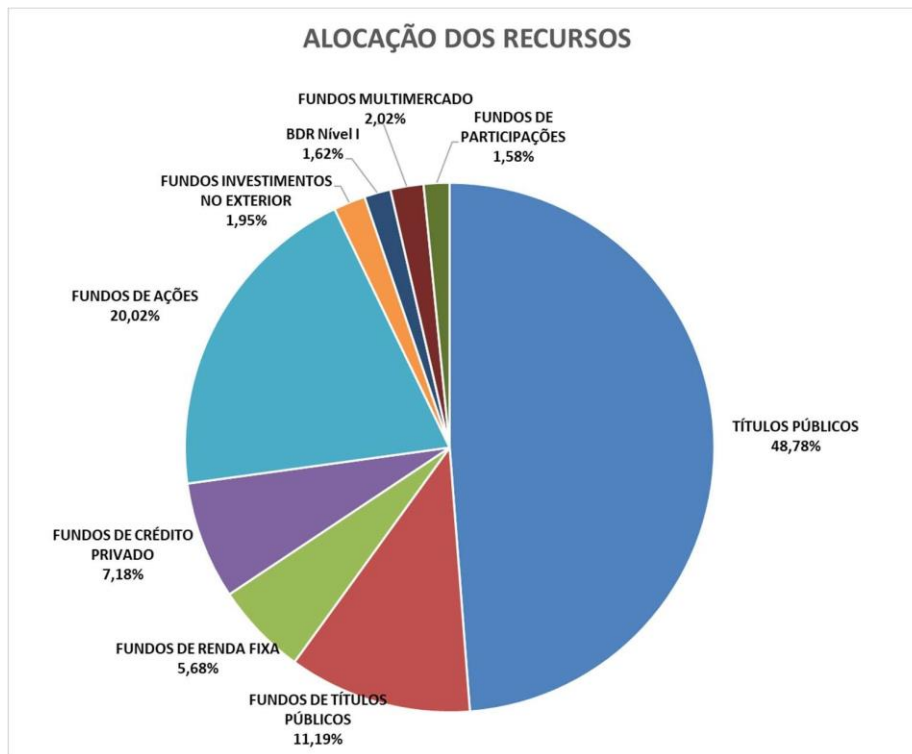


Gráfico 07

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO		TOTAL APLICADO	% CARTEIRA	LIMITE NO PL DO RPPS POR FUNDO
FI RF 100% TPF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 58.071.814,91	0,70%	100%
FI RENDA FIXA	BRABESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 66.072.686,38	0,80%	100%
	ITAU SOBERANO SIMPLES FIC - FUNDO NOVO	R\$ 53.764.892,37	0,65%	
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 147.536.221,89	1,79%	
	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 200.003.445,34	2,43%	
	ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 99.671.232,49	1,21%	
	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO DI FIC REF	R\$ 89.051.045,35	1,08%	
	CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 199.608.660,80	2,42%	
	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 22.417.071,02	0,27%	20%
	BRABESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 441.625.241,79	5,36%	
FI RF CREDITO PRIVADO	SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 37.003.164,76	0,45%	20%
	ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 101.376.703,29	1,23%	
	BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 103.022.632,31	1,25%	
	PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R\$ 102.182.940,09	1,24%	
	BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF	R\$ 107.124.586,03	1,30%	
	SAFRA EXTRA BANCOS FIC RF CRED PR	R\$ 135.706.819,91	1,65%	
CDB	CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE	R\$ -	0,00%	15%
FUNDOS DE AÇÕES	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 78.180.715,30	0,95%	20%
	AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 80.436.363,26	0,98%	
	BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 132.205.686,03	1,60%	
	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 59.191.641,58	0,72%	
	BRABESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 116.200.396,89	1,41%	
	BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 45.037.865,04	0,55%	
	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 215.175.359,69	2,61%	
	CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 40.714.080,80	0,49%	
	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 21.251.092,63	0,26%	
	ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 94.793.897,42	1,15%	
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 57.931.366,07	0,70%	
	ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 79.576.991,78	0,97%	
	OCCAM FIC FIA	R\$ 113.303.588,45	1,37%	
	VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 115.441.916,75	1,40%	
	GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 107.723.739,92	1,31%	
	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 48.285.696,98	0,59%	
	TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 53.845.022,56	0,65%	
	TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 105.835.054,92	1,28%	
	TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 5.546.807,14	0,07%	
	CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 47.882.818,57	0,58%	
	CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 16.413.871,65	0,20%	
INVEST NO EXTERIOR - FI	BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIO	R\$ 30.220.360,70	0,37%	20%
	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 34.452.022,68	0,42%	
	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 17.415.583,10	0,21%	
	SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 48.984.837,96	0,59%	
	SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 28.057.896,57	0,34%	
FIA - BDR	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 66.754.995,87	0,81%	20%
	ITAU BDR NIVE 1 AÇÕES	R\$ 33.792.094,90	0,41%	
	SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 31.390.933,70	0,38%	

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

FUNDOS MULTIMERCADO	SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$	41.619.756,66	0,50%	20%
	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$	20.040.508,45	0,24%	
	FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$	17.994.039,86	0,22%	
	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$	21.430.206,35	0,26%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM - FUNDO NOVO	R\$	11.733.921,62	0,14%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$	34.449.505,52	0,42%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$	17.729.236,91	0,22%	
FIP	BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$	40.751.339,99	0,49%	20%
	KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$	26.962.579,28	0,33%	
	BTG PACTUAL CLA ECONOMIA REAL II FIP MULT	R\$	6.257.563,28	0,08%	
	CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$	2.110.461,07	0,03%	
	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP	R\$	29.971.356,30	0,36%	
	BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$	22.704.603,77	0,28%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO		R\$	4.184.036.936,70		

Quadro 37

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO		TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL DO FUNDO	LIMITE RESOL. CMN 4.963/21
FI RF - 100% TPF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 58.071.814,91	R\$ 234.828.179,06	24,73%	100%
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 147.536.221,89	R\$ 5.184.189.770,00	2,85%	
	BRABESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 66.072.686,38	R\$ 468.218.135,18	14,11%	
	CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 199.608.660,80	R\$ 7.523.766.972,01	2,65%	
	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 200.003.445,34	R\$ 5.672.421.301,80	3,53%	
	ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 53.764.892,37	R\$ 56.639.505.158,53	0,09%	
	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO DI FIC REF	R\$ 89.051.045,35	R\$ 5.630.462.822,58	1,58%	
FI RENDA FIXA	ITAU INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 99.671.232,49	R\$ 2.228.464.987,02	4,47%	15%
	BRABESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 441.625.241,79	R\$ 10.247.341.113,60	4,31%	
	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 22.417.071,02	R\$ 14.627.876.402,56	0,15%	
FI RF CREDITO PRIVADO	SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 37.003.164,76	R\$ 1.197.077.989,09	3,09%	5%
	ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 101.376.703,29	R\$ 9.458.353.780,08	1,07%	
	BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 103.022.632,31	R\$ 2.779.077.425,95	3,71%	
	PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R\$ 102.182.940,09	R\$ 3.954.159.172,90	2,58%	
	BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF	R\$ 107.124.586,03	R\$ 13.233.154.738,80	0,81%	
	SAFRA EXTRA BANCOS FIC RF CRED PR	R\$ 135.706.819,91	R\$ 3.900.092.717,78	3,48%	
FUNDOS DE AÇÕES	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 78.180.715,30	R\$ 461.085.400,40	16,96%	15%
	AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 80.436.363,26	R\$ 1.275.100.529,68	6,31%	
	BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 132.205.686,03	R\$ 877.700.592,71	15,06%	
	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 59.191.641,58	R\$ 1.449.231.288,62	4,08%	
	BRABESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 116.200.396,89	R\$ 739.225.645,67	15,72%	
	BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 45.037.865,04	R\$ 291.570.251,09	15,45%	
	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 215.175.359,69	R\$ 1.351.408.126,44	15,92%	
	CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 40.714.080,80	R\$ 787.114.415,63	5,17%	
	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 21.251.092,63	R\$ 128.321.847,18	16,56%	
	ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 94.793.897,42	R\$ 673.895.914,30	14,07%	
	ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 57.931.366,07	R\$ 1.630.113.546,20	3,55%	
	ITAU SMALL CAP VALUATION	R\$ 79.576.991,78	R\$ 527.936.555,46	15,07%	
	OCCAM FIC FIA	R\$ 113.303.588,45	R\$ 805.798.112,59	14,06%	
	VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 115.441.916,75	R\$ 711.851.962,65	16,22%	
	GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 107.723.739,92	R\$ 2.057.268.947,71	5,24%	
	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 48.285.696,98	R\$ 554.617.745,77	8,71%	
	TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 53.845.022,56	R\$ 1.058.382.677,44	5,09%	
	TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 105.835.054,92	R\$ 1.911.235.425,13	5,54%	
	TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 5.546.807,14	R\$ 899.215.218,80	0,62%	
	CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 47.882.818,57	R\$ 1.351.868.322,42	3,54%	
	CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 16.413.871,65	R\$ 799.027.400,92	2,05%	
INVEST NO EXTERIOR - FI	BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 30.220.360,70	R\$ 1.256.953.555,38	2,40%	15%
	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 34.452.022,68	R\$ 109.748.968.022,74	0,03%	
	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 17.415.583,10	R\$ 17.277.614.142,16	0,10%	
	SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 48.984.837,96	R\$ 579.302.383,28	8,46%	
	SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 28.057.896,57	R\$ 29.141.702.187,79	0,10%	
FIA - BDR	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 66.754.995,87	R\$ 1.269.263.453,38	5,26%	15%
	ITAU BDR NIVEL 1 AÇÕES	R\$ 33.792.094,90	R\$ 241.424.185,71	14,00%	
	SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 31.390.933,70	R\$ 649.301.092,13	4,83%	

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

FUNDOS MULTIMERCADO	SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 41.619.756,66	R\$ 533.432.732,74	7,80%	15%
	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 20.040.508,45	R\$ 495.199.406,31	4,05%	
	FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$ 17.994.039,86	R\$ 123.089.701,51	14,62%	
	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ 21.430.206,35	R\$ 240.578.047,92	8,91%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM - FUNDO NOVO	R\$ 11.733.921,62	R\$ 177.715.768,71	6,60%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$ 34.449.505,52	R\$ 234.329.085,24	14,70%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$ 17.729.236,91	R\$ 142.822.769,83	12,41%	
FIP	BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 40.751.339,99	R\$ 3.043.627.274,13	1,34%	15%
	KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$ 26.962.579,28	R\$ 545.069.287,34	4,95%	
	BTG PACTUAL CLA ECONOMIA REAL II FIP MULT	R\$ 6.257.563,28	R\$ 121.486.735,32	5,15%	
	CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$ 2.110.461,07	R\$ 33.160.819,71	6,36%	
	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP	R\$ 29.971.356,30	R\$ 240.578.047,92	12,46%	
	BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 22.704.603,77	R\$ 476.519.229,23	4,76%	
	TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO	R\$ 4.184.036.936,70			

Quadro 38

Nota 1: Para os fundos de investimentos que comprem cotas de fundos de investimentos deve ser considerado, para fins de cumprimento deste artigo, o Patrimônio Líquido do fundo máster, conforme Art. 118 da Portaria MTP1467/2022.

Nota 2: Observa-se desenquadramento passivo em alguns fundos da Carteira, com resgate de cotas por outros cotistas dos fundos. Considerando o disposto na RESOLUÇÃO CMN Nº 4.963, DE 25 DE NOVEMBRO DE 2021, art. 27, os RPPS poderão manter em carteira, por até 180 (cento e oitenta) dias, as aplicações que passem a ficar desenquadradas em relação a esta Resolução, desde que seja comprovado que o desenquadramento foi decorrente de situações involuntárias, para as quais não tenha dado causa, e que o seu desinvestimento ocasionaria, comparativamente à sua manutenção, maiores riscos para o atendimento aos princípios previstos no art. 1º desta Resolução par. 1º. Para fins do disposto no caput, são consideradas situações involuntárias: inciso II - resgate de cotas de fundos de investimento por um outro cotista, nos quais o regime próprio de previdência social não efetue novos aportes. Assim sendo, o Comitê deverá manter acompanhando sistemático desses registros de forma a encaminhar à Diretoria as sugestões de movimentações adequadas.

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA NOVEMBRO/2023 EM R\$ MI	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (DEZEMBRO/2023)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 4.963/21
BB DTVM S.A	R\$ 1.526.400,13	R\$ 488.376.129,52	0,0320%	5%
CAIXA	R\$ 500.848,25	R\$ 507.772.095,63	0,1014%	
ITAU	R\$ 868.537,34	R\$ 426.113.280,90	0,0491%	
SAFRA	R\$ 125.259,80	R\$ 297.768.555,62	0,2377%	
BRDESCO	R\$ 655.854,99	R\$ 623.898.325,06	0,0951%	
ICATÚ	R\$ 44.326,85	R\$ 94.793.897,42	0,2139%	
BTG PACTUAL	R\$ 351.626,82	R\$ 407.952.007,49	0,1160%	
SANTANDER	R\$ 325.908,10	R\$ 85.988.002,72	0,0264%	
VINCI	R\$ 50.453,75	R\$ 165.838.074,80	0,3287%	
OCCAM	R\$ 4.876,79	R\$ 113.303.588,45	2,3233%	
PLURAL INVEST	R\$ 63.418,89	R\$ 51.867.605,78	0,0818%	
AZ QUEST	R\$ 22.014,25	R\$ 80.436.363,26	0,3654%	
BC GESTAO	R\$ 3.468,09	R\$ 45.037.865,04	1,2986%	
ARX	R\$ 26.984,70	R\$ 78.180.715,30	0,2897%	
SCHRODER	R\$ 25.042,41	R\$ 28.057.896,57	0,1120%	
DAYCOVAL	R\$ 14.062,88	R\$ 21.251.092,63	0,1511%	
GUEPARDO	R\$ 3.827,32	R\$ 107.723.739,92	2,8146%	
TRIGONO	R\$ 3.552,68	R\$ 59.391.829,70	1,6717%	
TARPON	R\$ 6.322,95	R\$ 105.835.054,92	1,6738%	
RIO BRAVO	R\$ 9.545,67	R\$ 63.912.664,05	0,6695%	
PORTO SEGURO	R\$ 24.276,75	R\$ 102.182.940,09	0,4209%	
CONSTANCIA	R\$ 1.896,76	R\$ 47.882.818,57	2,5245%	
BNP PARIBAS	R\$ 68.689,95	R\$ 107.124.586,03	0,1560%	
KINEA	R\$ 131.942,00	R\$ 26.962.579,28	0,0204%	
PATRIA INVEST	R\$ 46.858,61	R\$ 29.971.356,30	0,0640%	
CLARITAS	R\$ 7.151,07	R\$ 16.413.871,65	0,2295%	

Quadro 39

Nota 1: Para fins desse enquadramento, é aplicado o Ranking ANBIMA, atualizado bimestralmente, para o Gestores de Recursos de Terceiros.

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

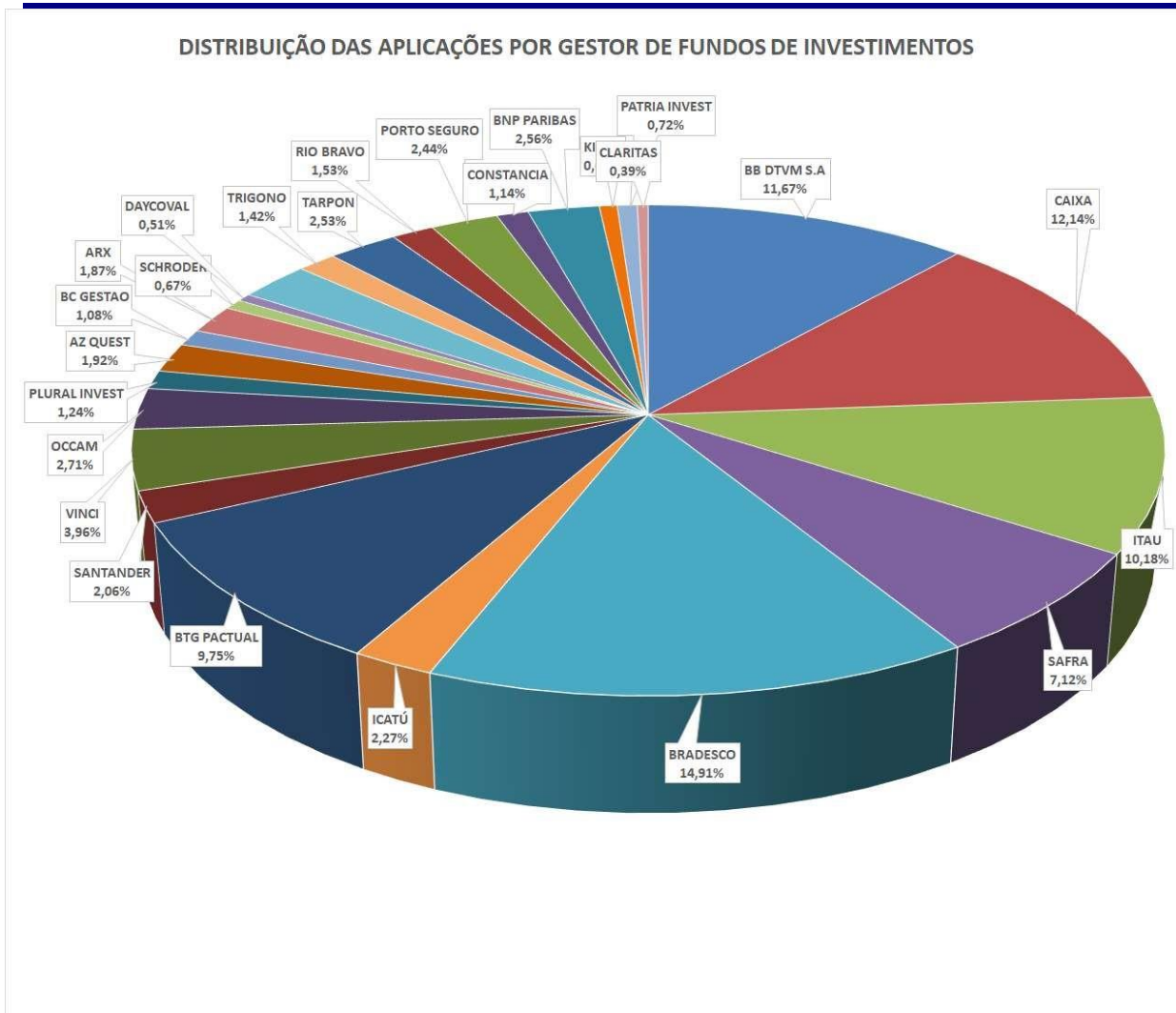


Gráfico 08

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

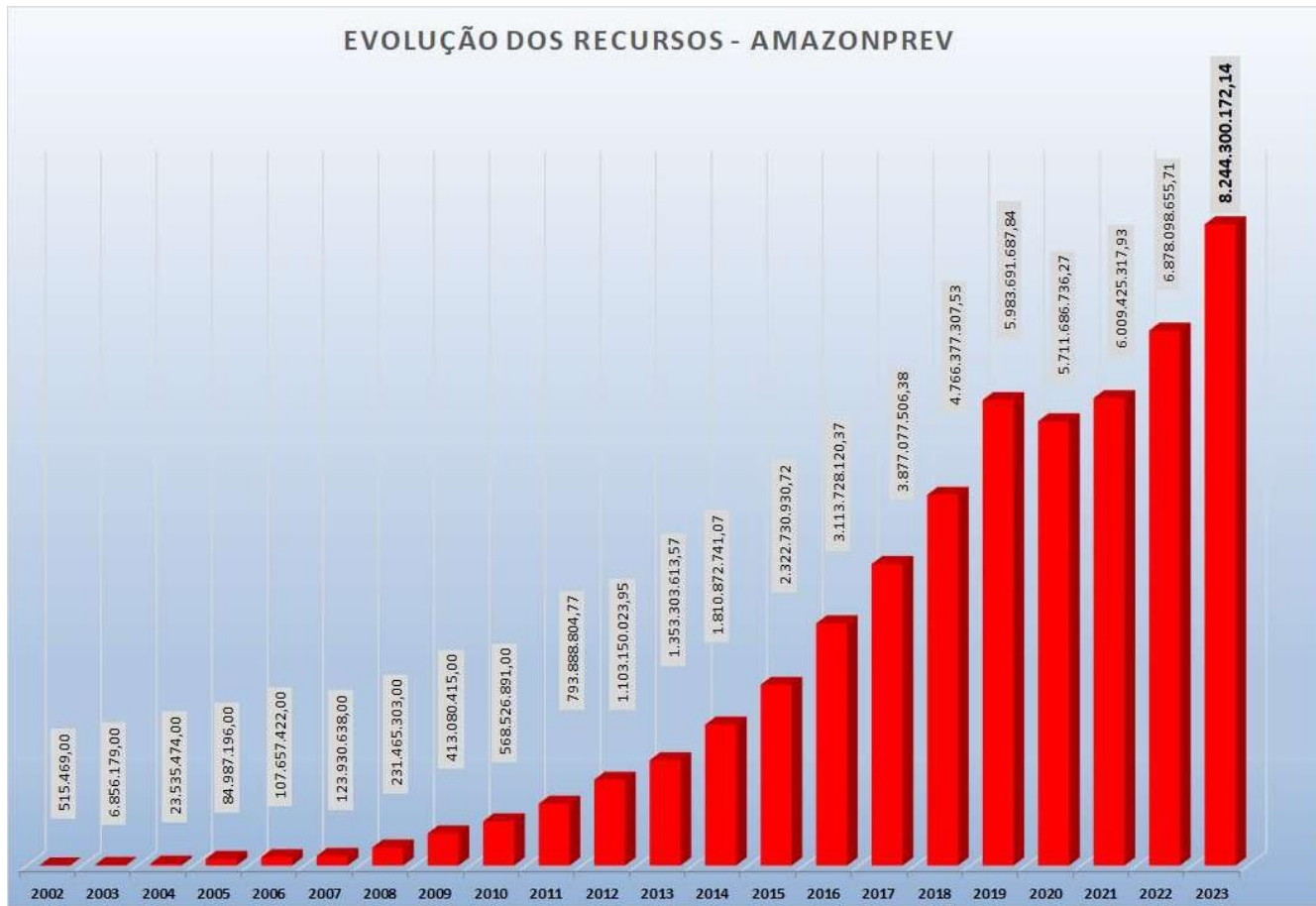


Gráfico 09

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
 Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
 Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDLYNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

Claudinei Soares
Coordenador

Bruno Barroso
Secretário

Bruno Costa Novo
Membro

Leonardo Cavalcanti
Membro

Wellington Guimaraes
Membro

Nuno Ponce
Membro

André Luiz Bentes
Membro

Augusto Sampaio
Membro

Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 26/02/2024 13:18:28
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/02/2024 08:31:24
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 27/02/2024 09:47:10

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/02/2024 12:52:48
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/02/2024 12:50:36
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 26/02/2024 13:01:20
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 26/02/2024 12:53:00
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 13:00:41

Documento assinado eletronicamente 452584/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTg0

