

Relatório Anual de Investimentos - 2018

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao exercício de 2018, destacando:

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 03 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 e Recursos Consolidados do FPREV (páginas 06 a 17);**
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário FPREV/ALEAM (páginas 18 a 19);**
- 4) Recursos do Ministério Público e Defensoria - FPREV - (páginas 19);**
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado – FPREV (páginas 20 a 21);**
- 6) Recursos do FFIN Executivo – (página 21 a 22);**
- 7) Recursos da Taxa de Administração - (página 22);**
- 8) Recursos dos Outros Poderes: Saldos e Composição – TCE e TJA (página 23);**
- 9) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 24 a 27);**
- 10) Total consolidado e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 28 a 29).**

1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

No Brasil, o Comitê de Política Monetária (Copom) manteve a taxa de juros em 6,5% a.a. na última reunião do ano, conforme o esperado. No comunicado houve destaque para uma melhora no balanço de riscos para a inflação. O comitê avalia que as diversas medidas de núcleo de inflação se encontram em níveis apropriados ou confortáveis. Na avaliação da atividade, os indicadores recentes continuam evidenciando uma recuperação gradual da economia. Além disso, o Copom retirou do comunicado o alerta sobre a possibilidade de elevação gradual da Selic em caso de piora no cenário prospectivo de inflação. Enquanto isso, o cenário global permanece com um quadro desafiador para as economias emergentes, tendo como principais riscos a normalização das taxas de juros em economias avançadas e as incertezas referentes ao comércio global. Segundo o Copom, diante da conjuntura econômica que prescreve uma política monetária estimulativa, a taxa Selic foi mantida em 6,5% a.a.. Esse patamar é compatível com a convergência da inflação para a meta no horizonte relevante, que inclui o ano de 2019 e, em menor grau, de 2020. No balanço de riscos para o cenário base, o Copom explicita que eventuais frustrações da continuidade das reformas e ajustes necessários na economia brasileira podem afetar as expectativas e as projeções macroeconômicas. Os próximos passos da política monetária continuam dependendo da evolução da atividade econômica, do balanço de riscos e das expectativas de inflação. Avalia-se que o Banco Central irá começar a elevar a taxa de juros no final do segundo semestre de 2019, tendo em vista a recuperação da atividade, e a convergência da inflação para a meta em 2020.

Os indicadores de atividade indicam recuperação lenta da economia, enquanto a inflação segue bem comportada. O dado mais recente do IBC-Br (indicador mensal de atividade) mostrou, em outubro, um avanço de 0,02%, após recuar 0,16% em setembro. Em termos anuais, a expansão foi de 3%, acelerando em relação ao mês anterior (0,91%). No ano, o indicador acumula alta de 1,4% na comparação com o mesmo período de 2017. Quanto ao mercado de trabalho, o CAGED indicou uma aceleração da criação de vagas formais em novembro, atingindo um nível de abertura líquida de 58,7 mil vagas. Em termos dessazonalizados, esse número aumentou para 72,5 mil, ante 40,1 mil no mês anterior. Esses dados estão condizentes com a estimativa de crescimento de 0,4% do PIB do 4º trimestre e 1,3% do PIB de 2018. Em termos de inflação, o IPCA-15 de dezembro registrou deflação de 0,16%, o menor resultado para o mês desde o Plano Real (1994). Com esse resultado, o IPCA-15 fechou 2018 com alta de 3,86%. A inflação deve continuar apresentando um quadro benigno nos próximos meses. Para o fechamento de dezembro, espera-se que o IPCA fique próximo de 0,10%. Caso isso se confirme, o IPCA vai

Relatório Anual de Investimentos - 2018

encerrar 2018 com alta de 3,7%, abaixo da meta do Banco Central (4,5%). Para 2019, espera-se que o índice registre crescimento de 3,7%.

No âmbito global, houve uma trégua na guerra comercial entre China e EUA. Os líderes dos dois países declararam uma trégua de 90 dias na guerra comercial que teve início em julho deste ano. Donald Trump, presidente americano, concordou em suspender o aumento de tarifas de 10% para 25% sobre US\$ 200 bilhões em importações chinesas que entraria em vigor em 1º de janeiro de 2019. Por sua vez, a China prometeu aumentar as compras de produtos agrícolas e industriais americanos. As negociações sobre um acordo comercial terão prosseguimento nos próximos meses, com a discussão sobre a redução da tarifa chinesa de importações de automóveis americanos, atualmente em 40%, segundo Trump. Caso os dois países não entrem em acordo, o aumento de tarifas deverá ser implementado.

Nos EUA, o Fed aumentou a taxa de juros na última reunião do ano, conforme o esperado. A autoridade monetária norte-americana decidiu, por unanimidade, elevar a taxa de juros em 25 pontos-base. Com isso, a taxa passou para o intervalo entre 2,25% a.a e 2,50% a.a. No ano, esse foi o quarto aumento da taxa básica. A avaliação do comitê explicitou que a economia segue com crescimento robusto e que o mercado de trabalho permanece com condições sólidas, com taxa de desemprego baixa e salários aumentando. No que concerne aos próximos passos da política monetária, o Fed reiterou que o ajuste da taxa de juros prosseguirá de forma gradual. Entretanto, houve uma mudança na sinalização futura da política monetária e as altas de juros se tornaram mais condicionadas à evolução da conjuntura econômica de curto prazo. Além disso, os dirigentes do Fed reduziram suas projeções de três para apenas duas novas altas das taxas de juros em 2019. Avalia-se que a mudança da comunicação do Fed após a decisão, juntamente com a revisão para baixo do patamar da taxa de juros neutra, indica que o comitê está mais cauteloso em relação ao nível de aperto da taxa de juros para o restante do ciclo monetário. Dessa forma, a projeção de quatro altas para duas elevações ao longo do próximo ano, com a taxa de juros dos Fed Funds terminando no intervalo entre 2,75 a 3,0% a.a. em 2019.

Na Zona do Euro, Banco Central Europeu (BCE) manteve os juros e confirmou o fim do programa de compras de ativos (QE, na sigla em inglês). O BCE manteve a taxa de juros de referência em zero e a taxa de depósito negativa em 0,4% a.a., conforme o esperado. Já a taxa de empréstimos segue em 0,25% a.a.. O BCE anunciou o encerramento do programa de compra de títulos, como planejado, e anunciou que a partir de janeiro iniciará a fase de reinvestimentos (recomprando dívidas que vencerem, mas sem aumentar suas carteiras), sem prazo determinado para encerrar. A autoridade monetária reafirmou o plano de manter os juros nos baixos níveis atuais pelo menos até outubro. Em seu discurso, Mario Draghi, reconheceu que os dados

Relatório Anual de Investimentos - 2018

econômicos estão mais fracos do que o esperado, mas disse que a força subjacente da economia confere confiança ao BCE de que a inflação convergirá para meta de 2%. Diante das incertezas que cercam a dinâmica da atividade, reforça-se o cenário de que o BCE não modificará a taxa de juros em 2019.

Na China, os dados de atividade decepcionaram em novembro e a inflação registrou variação abaixo do esperado. A produção industrial cresceu 5,4% na comparação anual de novembro, resultado abaixo da variação de outubro e da previsão dos analistas, ambas em 5,9%. Esse aumento é um dos menores desde 2009. No setor varejista, as vendas tiveram expansão anual de 8,1% em novembro, depois de aumentarem 8,6% em outubro, variação abaixo da expectativa de mercado de 8,8%. Por fim, o investimento em ativo fixo (FAI) teve crescimento de 5,9% entre janeiro e novembro, acima dos 5,7% registrado no período de janeiro e setembro, ambos em comparação com o mesmo período do ano anterior. Com relação aos dados de inflação, houve elevação de apenas 2,2% em termos anuais (ante 2,5% em outubro e 2,4% de expectativa) e contração de 0,3% em comparação ao mês anterior. O indicador de núcleo da inflação, por sua vez, permaneceu em 1,8% em termos anuais. Os dados de novembro reforçam o cenário de desaceleração da economia chinesa, que deve crescer 6,5% em 2018. Para 2019, diante dos impactos esperados da tensão comercial, o PIB chinês deverá desacelerar para um patamar mais próximo de 6,0%. Fonte: SÍNTESE ECONÔMICA DE DEZEMBRO – BRAM.

Relatório Anual de Investimentos - 2018

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO %						
	30/11/2018	31/12/2018	out/18	nov/18	dez/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 588.579.061,61	R\$ 591.436.393,94	0,5365	0,4855	0,4855	1,5151%	6,3246%	6,3246%	
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.286.821,89	R\$ 59.081.978,58	3,1697	0,1488	1,3642	4,7328%	6,0561%	NC	
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 1.602.459,74	R\$ 9.976.576,35	-	0,4699	0,4694	0,9415%	0,9415%	NC	
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF	R\$ 18.901.433,97	R\$ 29.070.419,11	0,9351	0,5283	0,5423	2,0186%	3,8652%	NC	
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF	R\$ 43.203.371,11	R\$ 43.605.856,12	1,7092	0,1000	0,9315	2,7593%	8,7500%	8,7500%	
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 46.341.721,60	R\$ 47.176.802,93	6,1488	0,1166	1,8025	8,1881%	11,3700%	11,3700%	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 225.671.713,38	R\$ 228.664.067,28	1,6936	0,3748	1,3260	3,4283%	6,1361%	NC	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 629.471.900,06	R\$ 638.148.398,84	3,0973	0,1348	1,3784	4,6593%	10,5062%	NC	
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 67.529.949,36	R\$ 68.746.040,33	-	1,6801	1,8008	3,5111%	3,5111%	NC	
SANTANDER FIC FI INST. RF REF DI	R\$ 77.538.130,95	R\$ 77.929.446,68	0,5405	0,4933	0,5047	1,5465%	6,4060%	NC	
SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	R\$ 159.356.181,51	R\$ 161.498.787,27	3,1013	0,1270	1,3445	4,6202%	7,6659%	NC	
BB PREVID RF IRF MI	R\$ 368.381.561,51	R\$ 380.418.978,54	0,9348	0,5204	0,5360	2,0039%	6,7563%	6,7563%	
BB PREVID TP VII	R\$ 18.740.222,40	R\$ 18.957.943,62	2,4861	0,1671	1,1617	3,8499%	9,7956%	9,7956%	
BB PREVID TP IX	R\$ 8.913.371,21	R\$ 8.955.314,25	0,5205	0,4715	0,4705	1,4696%	7,4424%	7,4424%	
BB PREVID IDKA 2	R\$ 520.578.266,62	R\$ 526.943.106,02	2,0897	0,1085	1,2226	3,4500%	6,9350%	NC	
BB PREVID RF IMA B5+	R\$ 101.490.932,87	R\$ 103.358.326,50	-	1,5822	1,8399	3,4512%	3,4512%	NC	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 220.145.046,34	R\$ 223.451.683,80	0,5088	0,7500	1,5020	2,7836%	8,2300%	8,2300%	
TOTAL	R\$ 3.154.732.146,13	R\$ 3.217.420.120,16							

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO %						
	30/11/2018	31/12/2018	out/18	nov/18	dez/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO	R\$ 5.337.766,56	R\$ 5.382.009,00	1,8299	0,6028	0,8289	3,2928%	7,6402%	NC	
CAIXA FI JUROS E MOEDAS	R\$ 15.472.029,02	R\$ 15.543.788,95	0,5573	0,3920	0,4638	1,4197%	3,6273%	NC	
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 3.480.510,19	R\$ 3.466.870,81	4,7515	3,3047	(0,3918)	7,7892%	-4,1884%	NC	
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 32.431.689,02	R\$ 32.565.194,04	11,4350	2,1810	0,4100	14,3322%	11,9913%	NC	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 18.205.184,07	R\$ 33.622.002,29	11,9700	3,0600	0,0561	15,4611%	4,3334%	NC	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 2.347.038,16	R\$ 2.433.185,55	14,2327	2,8900	3,6705	21,8481%	19,4249%	NC	
SAFRA S&P REAIS	R\$ 4.900.102,52	R\$ 4.497.393,48	(6,6459)	1,8008	(8,9543)	-13,4745%	-11,4345%	NC	
SAFRA PREMIUM MULTMERCADO	R\$ 5.148.743,68	R\$ 5.167.238,26	0,8912	0,6882	0,3579	1,9490%	2,5777%	NC	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 10.219.536,06	R\$ 25.910.354,60	-	2,1954	2,2298	4,4741%	4,4774%	NC	
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 9.957.601,79	R\$ 25.766.949,73	-	(0,4240)	2,8025	2,3666%	2,3698%	NC	
TOTAL	R\$ 107.500.201,07	R\$ 154.354.986,71							

TOTAL GERAL	R\$ 3.262.232.347,20	R\$ 3.371.775.106,87
--------------------	-----------------------------	-----------------------------

Quadro 1

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

2.2 EVOLUÇÃO DOS SALDOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXECUTIVO

INSTITUIÇÃO	out/18	nov/18	dez/18
BRADESCO	R\$ 656.736.607,55	R\$ 648.468.343,24	R\$ 660.494.948,87
CAIXA	R\$ 1.033.322.524,27	R\$ 1.055.410.395,25	R\$ 1.079.804.253,37
BANCO DO BRASIL	R\$ 1.005.077.128,21	R\$ 1.018.104.354,61	R\$ 1.038.633.668,93
ITAÚ	R\$ 238.451.483,01	R\$ 240.697.268,57	R\$ 259.506.871,64
SANTANDER	R\$ 268.051.017,53	R\$ 269.326.001,48	R\$ 271.993.427,99
SAFRA	R\$ 9.926.978,67	R\$ 10.048.846,20	R\$ 9.664.631,74
ICATÚ	R\$ -	R\$ 10.219.536,06	R\$ 25.910.354,60
BTG	R\$ -	R\$ 9.957.601,79	R\$ 25.766.949,73
TOTAL	R\$ 3.211.565.739,24	R\$ 3.262.232.347,20	R\$ 3.371.775.106,87

Relatório Anual de Investimentos - 2018

Quadro 2

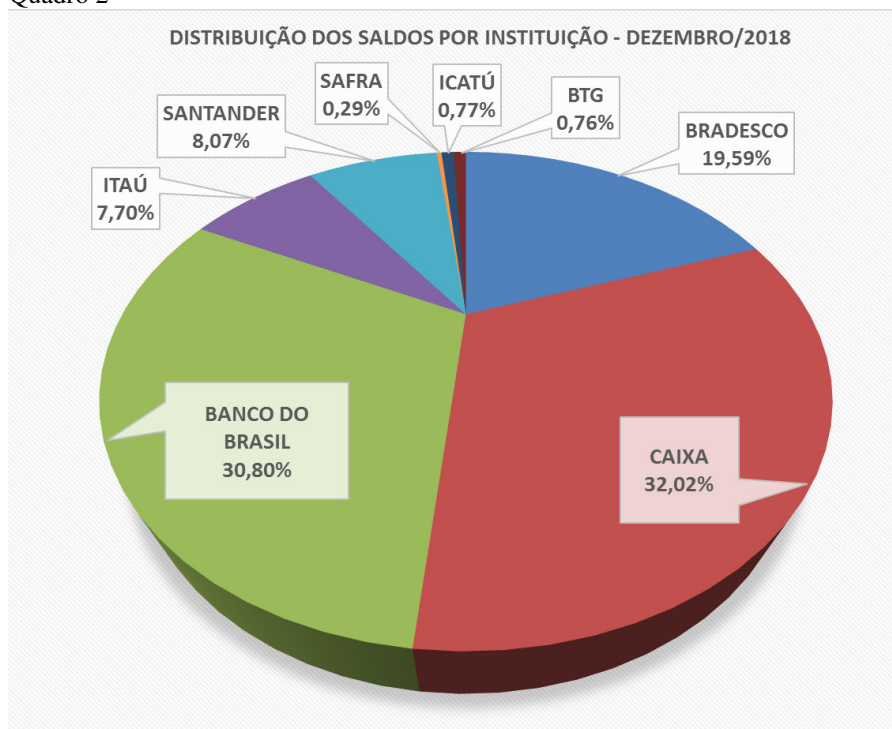


Gráfico 1

2.3 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA

FUNDO DE INVESTIMENTO	ÍNDICE DE REFERÊNCIA	SALDO APLICADO	% APLICADO
BRADESCO FI REFER DI PREMIUM BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA BRADESCO FI MAXI PODER PUBLICO SANTANDER FIC FI INST. RF REF DI ITAÚ INST. REFERENCIADO DI FI	CDI	R\$ 679.342.416,97	20,15%
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIM LP SAFRA CART PREMIUM MM	CDI ATIVO	R\$ 472.826.778,29	14,02%
CAIXA FI BRASIL IRF M1 TP RF BB PREVID RF IRF M1	IRF M 1	R\$ 409.489.397,65	12,14%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5 CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	IMA B 5	R\$ 858.729.164,69	25,47%
BB PREVID IDKA 2 TP RF	IDKA 2	R\$ 526.943.106,02	15,63%
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP BB PREVID RF IMA B5+	IMA B 5+	R\$ 172.104.366,83	5,10%
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF BB PREVID TP VII BB PREVID TP IX	IPCA + 6%	R\$ 118.695.916,92	3,52%
SAFRA S&P REAIS	S&P 500	R\$ 4.497.393,48	0,13%
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO CAIXA CONSUMO FI AÇÕES ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA BTG ABSOLUTO FIQ FIA	IBOVESPA	R\$ 129.146.566,02	3,83%
TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO		R\$ 3.371.775.106,87	100%

Quadro 3

Relatório Anual de Investimentos - 2018

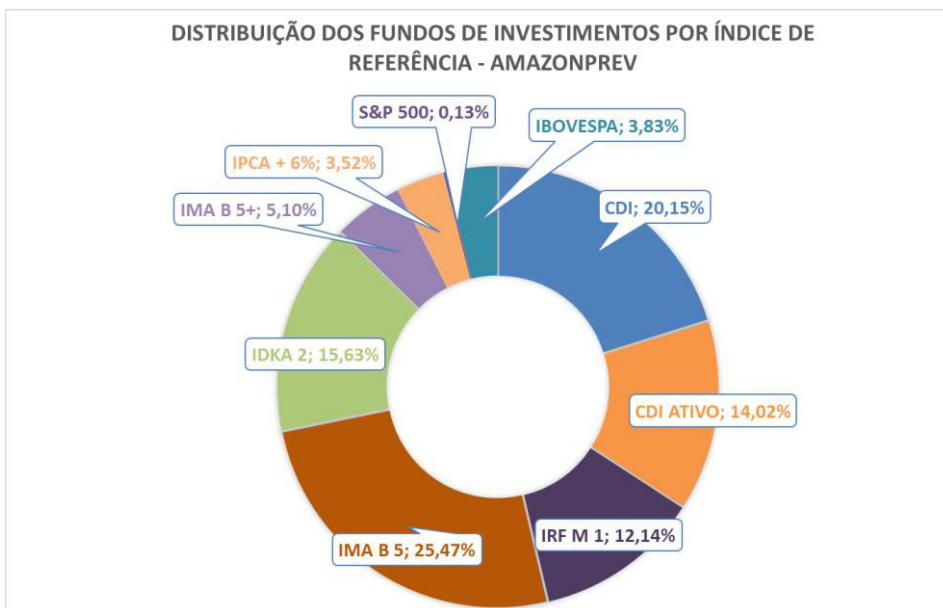
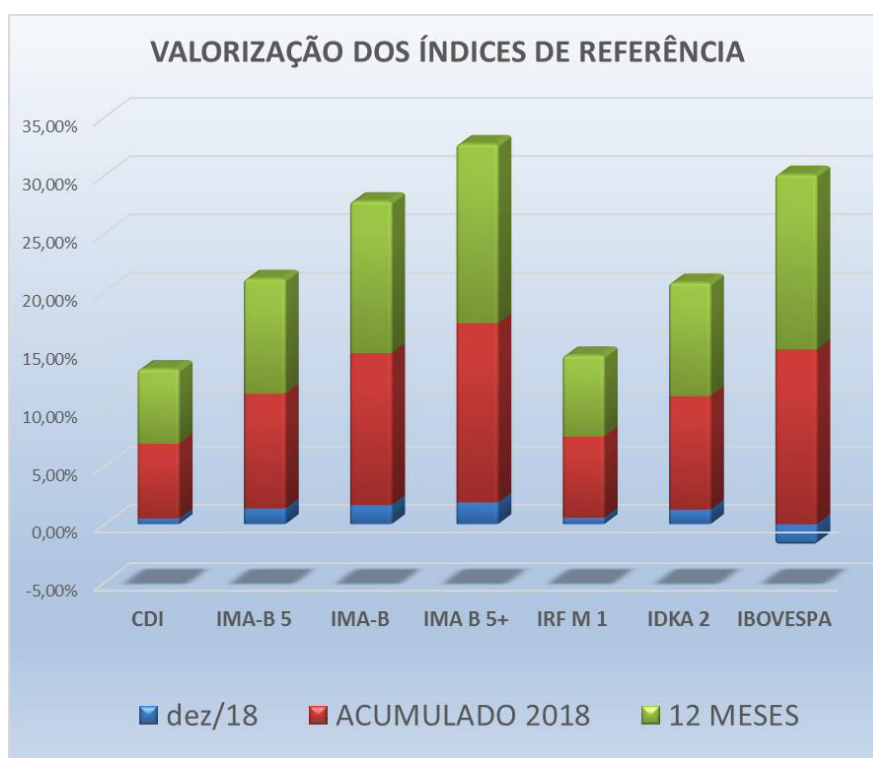


Gráfico 2

2.4 COMPARATIVO DOS ÍNDICES DE REFERÊNCIA

ÍNDICE	dez/18	ACUMULADO 2018	12 MESES
CDI	0,4900%	6,4200%	6,4200%
IMA-B 5	1,3631%	9,8655%	9,8655%
IMA-B	1,6494%	13,0587%	13,0587%
IMA B 5+	1,8785%	15,4051%	15,4051%
IRF M 1	0,5575%	6,9745%	6,9745%
IDKA 2	1,2537%	9,7540%	9,7540%
IBOVESPA	-1,8100%	15,0300%	15,0300%

Quadro 4



Relatório Anual de Investimentos - 2018

Gráfico 3.

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2018	31/12/2018	out/18	nov/18	dez/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 144.030.686,09	R\$ 145.003.444,87	0,9770	0,3135	0,6754	1,9776%	12,8004%	12,8004%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 149.469.639,42	R\$ 150.493.233,29	0,9864	0,3229	0,6848	2,0063%	10,3100%	10,3100%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 152.095.675,33	R\$ 153.173.144,45	1,0101	0,3464	0,7084	2,0780%	10,6221%	10,6221%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 154.727.580,93	R\$ 155.787.206,45	0,9864	0,3229	0,6848	2,0064%	10,5015%	10,5015%
TOTAL GERAL	R\$ 600.323.581,77	R\$ 604.457.029,06						

Quadro 5.

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

Nota 2: Foi retificado o valor registrado de atualização dos TPF: NTN-B (15/01/14 - 15/05/23) para o mês de novembro/18, pois não havia sido considerado o pagamento de cupom de juros semestrais no valor de R\$ 4.027.540,14.

2.6 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS – TPF

SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
TIPO DE ATIVO	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B
INTERMEDIÁRIO	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO
PREÇO UNITÁRIO DE COMPRA	R\$ 2.314,742871	R\$ 2.288,539269	R\$ 2.235,637189	R\$ 2.254,343911
PREÇO UNITÁRIO ATUAL	R\$ 3.391,357978	R\$ 3.395,472186	R\$ 3.401,603505	R\$ 3.443,586107
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\$ 145.003.444,87	R\$ 150.493.233,29	R\$ 153.173.144,45	R\$ 155.787.206,45
DATA DE EMISSÃO	15/01/2014	10/02/2010	10/02/2010	10/02/2010
DATA DA APLICAÇÃO	15/01/2014	15/01/2014	29/01/2014	15/01/2014
DATA DO RESGATE	15/05/2023	15/08/2030	15/08/2030	15/08/2040
TAXA DE JUROS CONTRATADA	6,48%	6,5998%	6,90%	6,60%

Quadro 6

2.7 SALDOS CVS - FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	30/11/2018	31/12/2018
CVS - A	R\$ 1.693.785,78	R\$ 1.676.332,46
CVS - B	R\$ 10.960.447,50	R\$ 10.847.469,70
CVS - C	R\$ 219.721,32	R\$ 217.457,24
CVS - D	R\$ 1.201.959,00	R\$ 1.189.569,48
TOTAL	R\$ 14.075.913,60	R\$ 13.930.828,88

Quadro 7

Relatório Anual de Investimentos - 2018

2.8 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/18	R\$ 45.365,76	R\$ 144.957,83	R\$ 190.323,59
fev/18	R\$ 44.946,11	R\$ 145.084,72	R\$ 190.030,83
mar/18	R\$ 44.526,14	R\$ 145.084,72	R\$ 189.610,86
abr/18	R\$ 44.106,16	R\$ 145.084,72	R\$ 189.190,88
mai/18	R\$ 43.686,19	R\$ 145.084,72	R\$ 188.770,91
jun/18	R\$ 43.266,22	R\$ 145.084,72	R\$ 188.350,94
jul/18	R\$ 42.846,25	R\$ 145.084,72	R\$ 187.930,97
ago/18	R\$ 42.426,28	R\$ 145.084,72	R\$ 187.511,00
set/18	R\$ 42.006,30	R\$ 145.084,72	R\$ 187.091,02
out/18	R\$ 41.586,33	R\$ 145.084,72	R\$ 186.671,05
nov/18	R\$ 41.166,36	R\$ 145.084,72	R\$ 186.251,08
dez/18	R\$ 40.746,39	R\$ 145.084,72	R\$ 185.831,11
TOTAL	R\$ 516.674,49	R\$ 1.740.889,75	R\$ 2.257.564,24

Quadro 8

2.9 RELAÇÃO DE IMÓVEIS

Nº	Descrição do Imóvel	Valor da Avaliação ano 2017	Data Avaliação	Valor da Avaliação ano 2018	Percentual de valorização
1	Prédio onde funciona UEA/ SEAS - Av. Darcy Vargas, Bairro Chapada - Manaus - AM	R\$ 27.556.000,00	12/11/2018 (UEA)	R\$ 25.063.000,00	-9,05%
		R\$ 33.954.000,00	09/11/2018 (SEAS)	R\$ 33.917.000,00	-0,11%
2	Prédio do IPASEA - Av. Governador Gilberto Mestrinho - Fonte Boa - AM	R\$ 400.000,00	09/11/2018	R\$ 392.000,00	-2,00%
3	Prédio da Rua Ipixuna, nº 754 - Centro Manaus - AM (PRESI)	R\$ 1.178.000,00	09/11/2018	R\$ 1.218.000,00	3,40%
4	Prédio onde Funcionava a Gerência Jurídica - GEJUR - Rua Ipixuna, 758 Centro Manaus - AM	R\$ 365.000,00	09/11/2018	R\$ 376.000,00	3,01%
5	Prédio onde Funcionava a Gerência Administrativa - Rua Duque de Caxias, 471 Manaus - AM	R\$ 818.000,00	09/11/2018	R\$ 843.000,00	3,06%
6	Imóvel Casa Residência onde funciona a FUNAI - Rua Marechal Deodoro, nº 406 - Tefé - AM	R\$ 95.000,00	13/11/2018	R\$ 88.000,00	-7,37%
7	Imóvel Casa de Alvenaria - Travessa Rio Branco s/n, Parintins - AM	R\$ 162.000,00	12/11/2018	R\$ 163.000,00	0,62%
TOTAL		R\$ 64.528.000,00		R\$ 62.060.000,00	-3,82%

Quadro 9

Relatório Anual de Investimentos - 2018

2.10 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO	
	30/11/2018	31/12/2018
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 3.262.232.347,20	R\$ 3.371.775.106,87
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 600.323.581,77	R\$ 604.457.029,06
TÍTULOS CVS	R\$ 14.075.913,60	R\$ 13.930.828,88
IMÓVEIS	R\$ 62.060.000,00	R\$ 62.060.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 22.884,89	R\$ -
TOTAL	R\$ 3.938.714.727,46	R\$ 4.052.222.964,81

Quadro 10

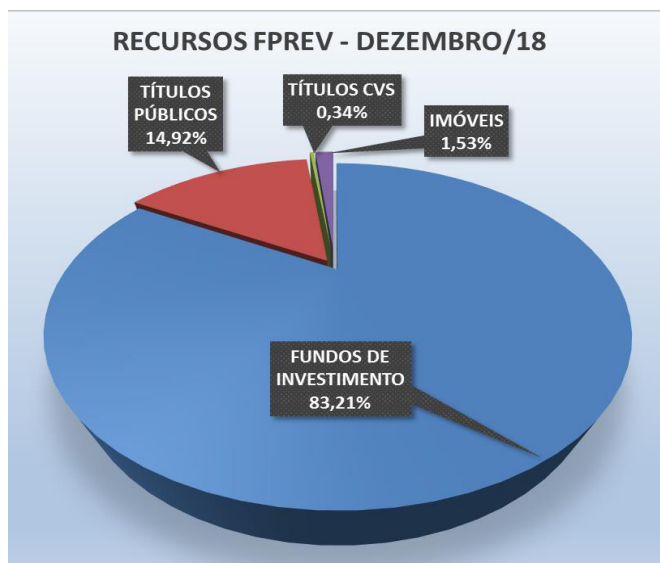


Gráfico 4

2.11 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS – FPREV EXECUTIVO

Mês	Recursos FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
jan/18	R\$ 3.432.495.345,53	2,47%	2,47%	24,58%
fev/18	R\$ 3.476.496.589,48	1,28%	3,79%	22,11%
mar/18	R\$ 3.535.665.708,63	1,70%	5,55%	21,86%
abr/18	R\$ 3.575.920.197,63	1,14%	6,76%	22,04%
mai/18	R\$ 3.561.828.017,47	-0,39%	6,34%	20,65%
jun/18	R\$ 3.598.964.002,84	1,04%	7,44%	20,22%
jul/18	R\$ 3.698.286.196,44	2,76%	10,41%	19,65%
ago/18	R\$ 3.733.589.594,73	0,95%	11,46%	18,50%
set/18	R\$ 3.796.010.936,86	1,67%	13,33%	18,04%
out/18	R\$ 3.892.701.887,62	2,55%	16,21%	19,68%
nov/18	R\$ 3.938.714.727,46	1,18%	17,59%	19,70%
dez/18	R\$ 4.052.222.964,81	2,88%	20,98%	20,98%

Quadro 11

Relatório Anual de Investimentos - 2018

2.12 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO

IPCA

PERÍODO	TAXA
dezembro/17	0,44%
novembro/18	-0,21%
dezembro/18	0,15%
Acumulado no ano de 2018	3,75%
Meta Atuarial no mês	0,6375%

Quadro 12

DESCRIÇÃO	DEZEMBRO/18	ACUMULADO 2018	ACUMULADO 2005 - 2018
RENTABILIDADE DO FPREV	1,0329%	8,3612%	422,8991%
META ATUARIAL	0,6375%	9,9702%	380,6193%
RESULTADO ATUARIAL	0,3929%	-1,4631%	8,7969%

Quadro 13

Nota: Rentabilidade validada pelo atuário.

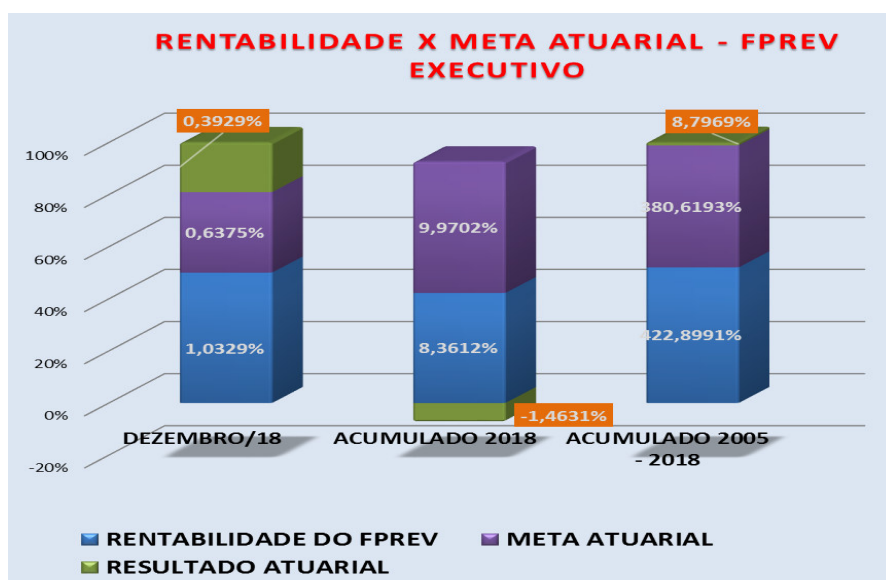


Gráfico 5.

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/11/2018	31/12/2018	out/18	nov/18	dez/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO FI REF. FEDERAL EXTRA	R\$ 3.359.531,41	R\$ 3.375.633,16	0,5300	0,4752	0,4822	1,4947%	6,2200%	NC	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 1.893.454,45	R\$ 2.102.139,37	1,6936	0,3748	1,3260	3,4282%	7,8151%	NC	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA II	R\$ 1.905.885,27	R\$ 2.118.806,81	-	0,7879	1,5020	2,3018%	8,2300%	NC	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -							
TOTAL	R\$ 7.158.871,13	R\$ 7.596.579,34							

Quadro 14

Relatório Anual de Investimentos - 2018

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos – ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2018	31/12/2018	out/18	nov/18	dez/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.039.942,38	R\$ 2.053.912,26	0,9864	0,3229	0,6848	2,0063%	10,3100%	10,3100%
TOTAL GERAL	R\$ 2.039.942,38	R\$ 2.053.912,26						

Quadro 15

3.3 Composição dos Recursos – ALE/FPREV

FUNDO DE INVESTIMENTO	out/18	nov/18	dez/18
SALDO ANTERIOR	8.813.437,96	9.012.136,46	9.198.813,51
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	102.421,40	143.781,95	468.098,91
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	96.277,10	42.895,10	(16.420,82)
SALDO FINAL	9.012.136,46	9.198.813,51	9.650.491,60

Quadro 16

3.4 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO	
	30/11/2018	31/12/2018
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 7.158.871,13	R\$ 7.596.579,34
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.039.942,38	R\$ 2.053.912,26
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 9.198.813,51	R\$ 9.650.491,60

Quadro 17

3.5 Evolução dos Recursos – ALE/FPREV

Mês	Recursos ALE FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
jan/18	R\$ 7.784.283,78	2,77%	32,44%	27,36%
fev/18	R\$ 7.911.489,25	1,63%	29,44%	26,32%
mar/18	R\$ 8.048.711,42	1,73%	6,26%	26,54%
abr/18	R\$ 8.223.861,55	2,18%	8,57%	27,19%
mai/18	R\$ 8.150.747,92	-0,89%	7,61%	23,46%
jun/18	R\$ 8.251.023,62	1,23%	8,93%	21,08%
jul/18	R\$ 8.522.044,39	3,28%	12,51%	22,15%
ago/18	R\$ 8.654.232,19	1,55%	14,25%	21,23%
set/18	R\$ 8.992.274,76	3,91%	18,72%	24,11%
out/18	R\$ 9.012.136,46	0,22%	18,98%	22,63%
nov/18	R\$ 9.198.813,51	2,07%	21,44%	25,17%
dez/18	R\$ 9.650.491,60	4,91%	27,41%	27,41%

Quadro 18

3.6 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

DESCRIÇÃO	DEZEMBRO/18	ACUMULADO 2018	ACUMULADO 2012 - 2018
RENTABILIDADE DO FPREV	0,9382%	7,4915%	125,206791%
META ATUARIAL	0,6375%	9,9702%	121,345235%
RESULTADO ATUARIAL	0,2988%	-2,2540%	1,744585%

Quadro 19

Relatório Anual de Investimentos - 2018

4. RECURSOS DO MPE e DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2018	31/12/2018	out/18	nov/18	dez/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO FI REF DI PREMIUM	R\$ 98.872.776,18	R\$ 99.352.766,72	0,5365	0,4855	0,4915	1,5212%	6,3300%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 98.872.776,18	R\$ 99.352.766,72						

Quadro 20

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

DESCRIÇÃO	DEZEMBRO/18	ACUMULADO 2018
RENTABILIDADE DO FPREV	0,4855%	4,5242%
META ATUARIAL	0,6375%	5,8356%
RESULTADO ATUARIAL	-0,1511%	-1,2391%

Quadro 21

Nota: Registra-se que Ministério Público Estadual, representado pela Procuradoria Geral de Justiça do Estado do Amazonas – PGJ/AM, depositou no dia 04/05/2018, o valor de R\$ 95.520.906,30 a título de contribuições passadas, corrigidas pela meta atuarial do período de janeiro/2004 a novembro/17, devidas ao Fundo Previdenciário de seus servidores conforme disposto no Termo de Compromisso de Adesão, celebrado com esta Unidade Gestora de Previdência em 14/11/2017. Considerando que as ações operacionais do processo de adesão ainda estão em curso, não estão sendo repassadas as contribuições mensais nem executadas as despesas previdenciárias, o que poderá alterar o resultado atuarial.

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)				
	30/11/2018	31/12/2018	nov/18	dez/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO FI REF DI PREMIUM	R\$ 598.798,24	R\$ 2.441.450,05	0,1676	0,4915	0,6599%	6,3300%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -					
TOTAL	R\$ 598.798,24	R\$ 2.441.450,05					

Quadro 22

4.4 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV

DESCRIÇÃO	DEZEMBRO/18	ACUMULADO 2018
RENTABILIDADE DO FPREV	0,9304%	1,8695%
META ATUARIAL	0,6375%	0,5888%
RESULTADO ATUARIAL	0,2911%	1,2732%

Quadro 23

Relatório Anual de Investimentos - 2018

5. CONSOLIDADO – FPREV ALE, EXECUTIVO, MPE E DEFENSORIA.

5.1 Evolução dos Recursos Consolidados – FPREV.

ANO	ALE FPREV	EXEC. FPREV	MPE FPREV	DPE FPREV	TOTAL FPREV
2004	R\$ -	R\$ 15.862.618,50	R\$ -		R\$ 15.862.618,50
2005	R\$ -	R\$ 57.510.136,49	R\$ -		R\$ 57.510.136,49
2006	R\$ -	R\$ 83.649.681,60	R\$ -		R\$ 83.649.681,60
2007	R\$ -	R\$ 75.698.485,78	R\$ -		R\$ 75.698.485,78
2008	R\$ -	R\$ 179.805.240,72	R\$ -		R\$ 179.805.240,72
2009	R\$ -	R\$ 341.872.841,56	R\$ -		R\$ 341.872.841,56
2010	R\$ -	R\$ 489.868.867,80	R\$ -		R\$ 489.868.867,80
2011	R\$ -	R\$ 657.928.672,97	R\$ -		R\$ 657.928.672,97
2012	R\$ 436.901,72	R\$ 936.612.579,50	R\$ -		R\$ 937.049.481,22
2013	R\$ 1.239.708,12	R\$ 1.166.915.511,62	R\$ -		R\$ 1.168.155.219,74
2014	R\$ 2.509.280,78	R\$ 1.571.464.403,45	R\$ -		R\$ 1.573.973.684,23
2015	R\$ 3.643.310,21	R\$ 2.012.490.466,39	R\$ -		R\$ 2.016.133.776,60
2016	R\$ 5.660.283,00	R\$ 2.700.997.719,11	R\$ -		R\$ 2.706.658.002,11
2017	R\$ 7.574.592,78	R\$ 3.349.596.826,89	R\$ -		R\$ 3.357.171.419,67
2018	R\$ 9.650.491,60	R\$ 4.052.222.964,81	R\$ 99.352.766,72	R\$ 2.441.450,05	R\$ 4.163.667.673,17

Quadro 24

5.2 Resumo do Fluxo de Caixa das Receitas e Despesas 2018 – FPREV.

Mês	Receitas	Despesas	Saldo	Patrimônio
				3.357.171.419,67
jan/18	41.653.212,18	1.259.551,29	40.393.660,89	3.440.184.176,32
fev/18	28.289.917,62	1.162.275,60	27.127.642,02	3.484.408.078,74
mar/18	30.689.645,26	1.331.523,40	29.358.121,86	3.543.714.420,05
abr/18	29.217.580,21	1.356.698,77	27.860.881,44	3.584.144.059,18
mai/18	119.241.731,96	1.363.754,02	117.877.977,94	3.665.960.737,15
jun/18	32.029.606,75	822.507,98	31.207.098,77	3.703.582.328,39
jul/18	31.932.761,61	2.080.315,11	29.852.446,50	3.803.175.542,76
ago/18	32.641.595,98	1.353.348,22	31.288.247,76	3.839.658.754,50
set/18	34.199.496,93	1.633.978,49	32.565.518,44	3.902.692.435,30
out/18	34.110.221,35	1.507.817,02	32.602.404,33	4.000.107.063,35
nov/18	34.480.401,28	1.464.475,87	33.015.925,41	4.047.385.115,39
dez/18	77.442.254,36	2.413.960,02	75.028.294,34	4.163.667.673,17
			Meta	9,97%
			Rentabilidade	8,34%
			Resultado	-1,48%

Quadro 25. Validado pelo atuário.

Nota: No exercício de 2018, apesar de um início com melhores expectativas, o país ainda sentiu os efeitos da grave crise econômica, potencializados pela crise política que vive o Congresso Nacional, afetando diretamente a vida das famílias e das empresas, encerrando o ano com uma combinação de crescimento abaixo do potencial e inflação moderada. Esse fato ficou mais evidente no momento em que se registrou a greve dos Caminhoneiros.

Relatório Anual de Investimentos - 2018

Além disso, ainda no Cenário Interno, o período que antecedeu às eleições Presidenciais trouxe muita volatilidade ao mercado, voltando à estabilidade ao fim de 2018 e trazendo expectativas positivas com o quadro que se formava com o novo Governo.

No Cenário Externo, as questões Geo Políticas balizaram os resultados desse exercício. Cresceram as tensões entre EUA e China, fortalecendo uma guerra comercial que trouxe efeito imediato aos países emergentes, com o registro de crescimento robusto da economia americana e continuidade do processo de alta de juros.

O efeito da crise interna, e do cenário externo, foi refletido na valorização dos Títulos Públicos Federais, em específico às NTN Bs, sendo esse o principal ativo que compõe as carteiras dos fundos de Renda Fixa em que a Amazonprev mantém recursos aplicados, representando 68,52% desse total, seja em Títulos do Tesouro ou em fundos indexados a esses ativos, onde foi percebido intensa volatilidade durante todo o exercício. Mesmo nesse cenário, a inflação teve variação abaixo do centro da meta, de 3,75% no ano, principalmente pelo baixo crescimento da indústria. Nesse Cenário, a Amazonprev buscou, num primeiro momento, ajustar a Carteira de Investimentos, direcionando os recursos para fundos de Renda Fixa cuja estratégia busca um ganho superior ao CDI ao mesmo tempo que mantinha a carteira protegida das oscilações do mercado. Com a melhora do Cenário, a partir do 2º semestre, buscou-se uma estratégia com maior aporte em Renda Variável, com direcionamento de recursos em Fundos de Ações, e Renda Fixa indexados em IMA B5+ (quadro 1), obtendo ganhos com a valorização desses ativos. Tal estratégia possibilitou o registro de uma Rentabilidade positiva no ano de 8,34%, apesar do Cenário adverso na maior parte do ano.

Para o exercício de 2019, o mercado projeta maior crescimento econômico, porém com inflação e taxa de juros sem grandes variações, de forma que a expectativa é um aumento de alocação de recursos em Renda Variável e em ativos de Renda Fixa que busquem resultados acima da taxa CDI, de forma a garantir melhor desempenho da Carteira nesse exercício.

6. RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

6.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Investimentos – FFIN Executivo

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/11/2018	31/12/2018	out/18	nov/18	dez/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 11.253.743,84	R\$ 10.128.579,28	0,5208	0,4720	0,4716	1,4716%	6,1490%	6,7010%	
BRADESCO FI RF IRF MI - COMPREV	R\$ 8.171.365,84	R\$ 8.204.597,24	0,9008	0,5244	0,5386	1,9763%	6,6867%	6,7200%	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1.170.746,06	R\$ -							
TOTAL	R\$ 20.595.855,74	R\$ 18.333.176,52							

Quadro 26

6.2 Defensoria Pública - FFIN

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/11/2018	31/12/2018	out/18	nov/18	dez/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO FI REF FEDERAL EXTRA	R\$ 295.453,05	R\$ 460.162,27	-	0,1676	0,4822	0,6505%	0,6505%	NC	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -							
TOTAL	R\$ 295.453,05	R\$ 460.162,27							

Quadro 27

Relatório Anual de Investimentos - 2018

6.3 Disponibilidade Financeira – FFIN EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/11/2018	31/12/2018
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 115.436,98	R\$ 112.128,83
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ 440.884,82	R\$ 17,70
REPASSES PATRONAIS	R\$ 186,35	R\$ -

Quadro 28

Nota: Salários Não Reclamados referem-se aos proventos de aposentadoria ou pensão que são devolvidos pelo Banco devido a inconsistências bancárias na folha de pagamento.

Nota: Valor de Cobertura do Déficit referente à IRRF s/ folha de pagamento, já regularizado.

6.4 Disponibilidade Financeira e Cobertura do Déficit - FFIN ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2018	31/12/2018
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 46.323,43	R\$ 1.940,70
TOTAL	R\$ 46.323,43	R\$ 1.940,70

Quadro 29

6.5 Composição do Recursos – ALE FFIN

DESCRIÇÃO	out/18	nov/18	dez/18
SALDO ANTERIOR	R\$ 5.837,68	R\$ 10.238,02	R\$ 46.323,43
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	R\$ 870.983,03	R\$ 1.199.306,07	R\$ 3.144.133,02
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ 1.345.658,31	R\$ 1.291.396,51	R\$ 1.758.739,48
VARIAÇÃO FINANCEIRA	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
SAIDAS FINANCEIRAS	-R\$ 2.212.241,00	-R\$ 2.454.617,17	-R\$ 4.947.255,23
SALDO FINAL	R\$ 10.238,02	R\$ 46.323,43	R\$ 1.940,70

Quadro 30

7. TAXA DE ADMINISTRAÇÃO DO EXECUTIVO E ALE

7.1 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2018	31/12/2018	out/18	nov/18	dez/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.568.931,46	R\$ 1.219.598,90	0,5208	0,4720	0,4716	1,4716%	6,4200%	6,4200%
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF	R\$ 37.905.942,24	R\$ 38.111.524,87	0,6351	0,5283	0,5423	1,7154%	6,8052%	6,8052%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 1.674.898,66						
TOTAL	R\$ 39.474.874,70	R\$ 41.006.022,43						

Quadro 31

7.2 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2018	31/12/2018	out/18	nov/18	dez/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 41.782,85	R\$ 394.365,58		0,4792	0,4716	0,9530%	6,4200%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 41.782,85	R\$ 394.365,58						

Quadro 32

Relatório Anual de Investimentos - 2018

8. RECURSOS DOS OUTROS PODERES – TJA E TCE

8.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	30/11/2018	31/12/2018	out/18	nov/18	dez/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO IRF M1 - TJA	R\$ 103.961.990,50	R\$ 110.282.134,69	0,5022	0,5244	0,5386	1,5734%	6,7200%	6,7200%
CAIXA FI BRASIL IRF M1 TP RF - TJA	R\$ 139.343.447,60	R\$ 140.099.175,84	0,9351	0,5283	0,5423	2,0186%	6,8052%	6,8052%
BB PREV. RF IRF M1 - TJA	R\$ 134.257.035,75	R\$ 134.976.674,83	0,9348	0,5204	0,5360	2,0039%	6,7563%	6,7563%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 14.642,76	R\$ 688,79						
TOTAL	R\$ 377.577.116,61	R\$ 385.358.674,15						

Quadro 33

8.2 Composição dos Saldos - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	out/18	nov/18	dez/18
SALDO ANTERIOR	366.717.503,08	372.779.305,77	377.577.116,61
REPASSES FINANCEIROS	2.999.187,14	2.980.818,91	5.972.687,39
VARIAÇÃO FINANCEIRA	3.194.212,36	1.950.296,79	2.042.370,93
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(131.596,81)	(133.304,86)	(233.500,78)
SALDO FINAL	R\$ 372.779.305,77	R\$ 377.577.116,61	R\$ 385.358.674,15

Quadro 34

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

8.3 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	30/11/2018	31/12/2018	out/18	nov/18	dez/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO IRF M1 - TCE	R\$ 44.525.683,95	R\$ 46.310.560,92	0,5022	0,5244	0,5386	1,5734%	6,7200%	6,7200%
CAIXA FI BRASIL IRF M1 TP RF - TCE	R\$ 55.857.452,08	R\$ 56.160.394,59	0,9351	0,5283	0,5423	1,4683%	6,8052%	6,8052%
BB PREV. RF IRF M1 - TCE	R\$ 54.281.234,61	R\$ 54.572.190,67	0,9348	0,5204	0,5360	2,0039%	6,7563%	6,7563%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 18.275,00	R\$ -						
TOTAL	R\$ 154.682.645,64	R\$ 157.043.146,18						

Quadro 35

8.4 Composição dos Saldos - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	out/18	nov/18	dez/18
SALDO ANTERIOR	150.723.382,40	152.685.324,61	154.682.645,64
REPASSES FINANCEIROS	825.872,95	1.334.684,35	1.759.444,56
VARIAÇÃO FINANCEIRA	1.308.343,66	800.673,19	835.938,71
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(172.274,40)	(138.036,51)	(234.882,73)
SALDO FINAL	R\$ 152.685.324,61	R\$ 154.682.645,64	R\$ 157.043.146,18

Quadro 36

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

Relatório Anual de Investimentos - 2018

9. ENQUADRAMENTO

9.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2018	LIMITE DA RESOLUÇÃO	Res. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
TÍTULOS DO TN	R\$ 606.510.941,31	12,90%	40,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 569.967.844,04	55,62%	40,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 18.957.943,62				
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ 8.955.314,25				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 103.358.326,50				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 526.943.106,02				
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 161.498.787,27				
BRADERCO FI RF IRFM 1 TP	R\$ 164.797.292,85				
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 263.441.514,41				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 638.148.398,84				
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 68.746.040,33				
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 43.605.856,12				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 47.176.802,93				
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 21.324.754,53				
BRADERCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 6.671.611,06				
BRADERCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 690.789.160,66				
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 59.081.978,58				
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 225.570.490,61				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 230.766.206,65				
SANTANDER FIC INST. RF REF DI	R\$ 77.929.446,68				
TÍTULOS CVS	R\$ 13.930.828,88	0,30%	ATIVO EM ENQUADRAMENTO	-	TÍTULO NÃO REGISTRADO NO SELIC
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 4.548.172.646,14	96,72%			

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2018	LIMITE DA RESOLUÇÃO	Res. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 33.622.002,29	0,71%	1%	30%	art. 8º, inciso I, "a"
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 3.466.870,81	1,92%	2%	20%	art. 8º, inciso II, "a"
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 2.433.185,55				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 25.910.354,60				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 25.766.949,73				
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 32.565.194,04				
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 4.497.393,48	0,65%	1%	10%	art. 8º, inciso III
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.382.009,00				
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	R\$ 5.167.238,26				
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	R\$ 15.543.788,95				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 154.354.986,71	3,28%			

TOTAL GERAL DA CARTEIRA	R\$ 4.702.527.632,85	100,00%
--------------------------------	-----------------------------	----------------

Quadro 37

Relatório Anual de Investimentos - 2018

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% CARTEIRA	Res. nº 3.922/2010 atualizada
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 569.967.844,04	11,96%	20%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 18.957.943,62	0,40%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ 8.955.314,25	0,19%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 103.358.326,50	2,17%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 526.943.106,02	11,06%	
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 161.498.787,27	3,39%	
BRADESCO FI RF IRFM 1 TP	R\$ 164.797.292,85	3,46%	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 263.441.514,41	5,53%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 638.148.398,84	13,39%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 68.746.040,33	1,44%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 43.605.856,12	0,91%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 47.176.802,93	0,99%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 21.324.754,53	0,45%	
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 6.671.611,06	0,14%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 690.789.160,66	14,49%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 59.081.978,58	1,24%	
ITAU INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 225.570.490,61	4,73%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 230.766.206,65	4,84%	
SANTANDER FIC INST. RF REF DI	R\$ 77.929.446,68	1,63%	
ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 33.622.002,29	0,71%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 3.466.870,81	0,07%	
ITAU INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 2.433.185,55	0,05%	
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 25.910.354,60	0,54%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 25.766.949,73	0,54%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 32.565.194,04	0,68%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 4.497.393,48	0,09%	
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.382.009,00	0,11%	
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	R\$ 5.167.238,26	0,11%	
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	R\$ 15.543.788,95	0,33%	
TOTAL DOS RECURSOS DO RPPS	R\$ 4.766.377.307,53		

Quadro 38

Nota: Enquadramento II - 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 Anual de Investimentos - 2018

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

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Res. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 569.967.844,04	R\$ 12.032.640.161,24	4,74%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	R\$ 18.957.943,62	R\$ 660.358.054,98	2,87%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX - 15/08/2018	R\$ 8.955.314,25	R\$ 120.401.118,20	7,44%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 103.358.326,50	R\$ 946.928.584,30	10,92%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 526.943.106,02	R\$ 6.854.500.353,12	7,69%	
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 161.498.787,27	R\$ 1.414.957.092,19	11,41%	
BRADERCO FI RF IRFM 1 TP	R\$ 164.797.292,85	R\$ 1.648.661.981,09	10,00%	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 263.441.514,41	R\$ 18.338.157.565,12	1,44%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 638.148.398,84	R\$ 11.498.930.142,73	5,55%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 68.746.040,33	R\$ 1.231.561.219,42	5,58%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 43.605.856,12	R\$ 255.311.973,20	17,08%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 47.176.802,93	R\$ 192.527.660,03	24,50%	
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 21.324.754,53	R\$ 423.354.176,52	5,04%	
BRADERCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 6.671.611,06	R\$ 6.818.674.974,42	0,10%	
BRADERCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 690.789.160,66	R\$ 7.300.537.475,50	9,46%	
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 59.081.978,58	R\$ 556.904.316,48	10,61%	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 225.570.490,61	R\$ 2.536.010.521,39	8,89%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 230.766.206,65	R\$ 3.163.516.828,54	7,29%	
SANTANDER FIC INST. REF DI	R\$ 77.929.446,68	R\$ 4.372.026.164,61	1,78%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 33.622.002,29	R\$ 783.807.802,01	4,29%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 3.466.870,81	R\$ 32.055.138,70	10,82%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 2.433.185,55	R\$ 1.408.001.737,08	0,17%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 25.910.354,60	R\$ 319.834.336,36	8,10%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 25.766.949,73	R\$ 878.200.709,46	2,93%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 32.565.194,04	R\$ 610.979.792,78	5,33%	

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14, § 1º	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Res. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	R\$ 15.543.788,95	R\$ 536.350.556,13	2,90%	5%
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.382.009,00	R\$ 268.097.230,20	2,01%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 4.497.393,48	R\$ 367.342.065,53	1,22%	
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	R\$ 5.167.238,26	R\$ 2.020.509.293,41	0,26%	

Quadro 39

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;

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

Relatório Anual de Investimentos - 2018

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA NOV/18) EM R\$ BI	TOTAL DE RECURSOS - ANBIMA	TOTAL RECURSOS - AMAZONPREV	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Res. n° . 3.922/2010 atualizada pela Res. n° 4.604/2017
BB DTVM S.A	R\$ 933.421,58	R\$ 933.421.580.000,00	R\$ 1.228.182.534,43	0,1316%	5%
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 662.334,35	R\$ 662.334.350.000,00	R\$ 261.625.678,45	0,0395%	
BRADESCO	R\$ 610.329,25	R\$ 610.329.250.000,00	R\$ 942.664.797,68	0,1545%	
CAIXA	R\$ 327.497,51	R\$ 327.497.510.000,00	R\$ 1.247.531.447,71	0,3809%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	R\$ 255.737,51	R\$ 255.737.510.000,00	R\$ 271.993.427,99	0,1064%	
BANCO SAFRA	R\$ 95.950,63	R\$ 95.950.630.000,00	R\$ 9.664.631,74	0,0101%	
BANCO BTG	R\$ 92.997,34	R\$ 92.997.340.000,00	R\$ 25.766.949,73	0,0277%	
ICATÚ	R\$ 18.863,92	R\$ 18.863.920.000,00	R\$ 25.910.354,60	0,1374%	

Quadro 40

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, para o Gestores de Recursos de Terceiros.

Relatório Anual de Investimentos - 2018

10. TOTAL DOS RECURSOS - AMAZONPREV

FPREV PODER EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 3.371.775.106,87
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 604.457.029,06
CVS	R\$ 13.930.828,88
IMÓVEIS	R\$ 62.060.000,00
DEFENSORIA PÚBLICA - FPREV	R\$ 2.441.450,05
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
TOTAL	R\$ 4.054.664.414,86

ASSEMBLEIA LEGISLATIVA - ALE FPREV E ALE FFIN

DESCRIÇÃO	SALDO
ALE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 7.596.579,34
ALE FPREV TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.053.912,26
ALE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
ALE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ -
ALE FFIN DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1.940,70
TOTAL	R\$ 9.652.432,30

MPE FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
MPE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 99.352.766,72
MPE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
TOTAL	R\$ 99.352.766,72

TAXA DE ADM. FFIN EXECUTIVO, COMPREV, SAL. NÃO RECL. E DISP. FINANCEIRA

DESCRIÇÃO	SALDO
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	R\$ 39.331.123,77
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - ALE	R\$ 394.365,58
FUNDO FINANCEIRO - EXECUTIVO	R\$ 10.128.579,28
FUNDO FINANCEIRO - COMPREV	R\$ 8.204.597,24
DEFENSORIA PÚBLICA - FFIN	R\$ 460.162,27
DISP. FINANCEIRA - TAXA DE ADM.	R\$ 1.674.898,66
DISP. FINANCEIRA - FFIN	R\$ -
DISP. FINANCEIRA - REP. COBERT. DEFICIT	R\$ 17,70
DISP. FINANCEIRA - SAL. NÃO RECLAMADOS	R\$ 112.128,83
DISP. REPASSES PATRONAIS	R\$ -
TOTAL	R\$ 60.305.873,33

OUTROS PODERES

ORGÃOS	SALDO
TJ/AM	R\$ 385.357.985,36
TCE/AM	R\$ 157.043.146,18
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA/TCE	R\$ 688,79
TOTAL	R\$ 542.401.820,33
TOTAL GERAL	4.766.377.307,53

Quadro 41

Relatório Anual de Investimentos - 2018



Gráfico 6.

Nota: Conforme PPA 2018-2022 o valor projetado para 2018, no total de R\$ 4.357.626,00, sendo superado no mês de agosto/2018.

Sem mais a informar, segue para Superior Consideração.

Respeitosamente,

Alan Nascimento
Coordenador

Bruno Costa Novo
Secretário

Leonardo Cavalcanti
Membro

Renício Ferreira
Membro

ANEXO

EXECUÇÃO

ORÇAMENTÁRIA

EXERCÍCIO DE 2018

ESTADO DO AMAZONAS
RELATÓRIO RESUMIDO DA EXECUÇÃO ORÇAMENTÁRIA
DEMONSTRATIVO DAS RECEITAS E DESPESAS PREVIDENCIÁRIAS DO REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES
ORÇAMENTO FISCAL E DA SEGURIDADE SOCIAL
PERÍODO DE REFERÊNCIA: JANEIRO A DEZEMBRO/2018 - 6º BIMESTRE: NOVEMBRO/DEZEMBRO

RREO - Anexo 4 (LRF, Art. 53, inciso II)

Em Reais

PLANO PREVIDENCIÁRIO

RECEITAS PREVIDENCIÁRIAS - RPPS	PREVISÃO INICIAL	PREVISÃO ATUALIZADA	RECEITAS REALIZADAS	
			Até o Bimestre/ <2018>	Até o Bimestre/ <2017>
RECEITAS CORRENTES (I)	426.565.000,00	426.565.000,00	636.869.684,99	397.270.797,99
Receita de Contribuições dos Segurados	160.335.000,00	160.335.000,00	225.142.530,37	152.915.266,12
Civil	128.528.000,00	128.528.000,00	180.949.410,86	120.662.748,53
Ativo	128.500.000,00	128.500.000,00	180.889.358,76	120.613.791,15
Inativo	1.000,00	1.000,00	18.977,82	17.198,23
Pensionista	27.000,00	27.000,00	41.074,28	31.759,15
Militar	31.807.000,00	31.807.000,00	44.193.119,51	32.252.517,59
Ativo	31.700.000,00	31.700.000,00	44.005.821,05	32.128.239,99
Inativo	100.000,00	100.000,00	174.455,55	104.433,34
Pensionista	7.000,00	7.000,00	12.842,91	19.844,26
Receita de Contribuições Patronais	190.776.000,00	190.776.000,00	274.937.335,72	180.021.277,74
Civil	152.633.000,00	152.633.000,00	219.059.112,96	141.893.334,47
Ativo	152.600.000,00	152.600.000,00	218.988.111,10	141.847.789,08
Inativo	1.000,00	1.000,00	22.459,52	8.011,25
Pensionista	32.000,00	32.000,00	48.542,34	37.534,14
Militar	38.143.000,00	38.143.000,00	55.878.222,76	38.127.943,27
Ativo	38.000.000,00	38.000.000,00	55.656.490,89	37.979.350,26
Inativo	135.000,00	135.000,00	206.553,88	137.431,43
Pensionista	8.000,00	8.000,00	15.177,99	11.161,58
Em Regime de Parcelamento de Débitos				
Receita Patrimonial	49.056.000,00	49.056.000,00	72.559.970,81	47.026.045,80
Receitas Imobiliárias	2.086.000,00	2.086.000,00	2.279.778,83	2.236.522,40
Receitas de Valores Mobiliários	46.970.000,00	46.970.000,00	70.280.191,98	44.789.523,40
Outras Receitas Patrimoniais				
Receita de Serviços	26.290.000,00	26.290.000,00	30.113.334,25	17.274.782,47
Outras Receitas Correntes	108.000,00	108.000,00	34.116.513,84	33.425,86
Compensação Previdenciária do RGPS para o RPPS				
Aportes Periódicos para Amortização de Déficit Atuarial do RPPS (II) ¹				
RECEITAS DE CAPITAL (III)	1.739.000,00	1.739.000,00	1.740.762,84	1.736.750,29
Alienação de Bens, Direitos e Ativos				
Amortização de Empréstimos				
Outras Receitas de Capital	1.739.000,00	1.739.000,00	1.740.762,84	1.736.750,29
TOTAL DAS RECEITAS PREVIDENCIÁRIAS RPPS - (IV) = (I + III - II)	428.304.000,00	428.304.000,00	638.610.447,83	399.007.548,28

DESPESAS PREVIDENCIÁRIAS - RPPS	DOTAÇÃO INICIAL	DOTAÇÃO ATUALIZADA	DESPESAS EMPENHADAS		DESPESAS LIQUIDADAS		INSCRITAS EM RESTOS A PAGAR NÃO PROCESSADOS	
			Até o Bimestre/ <2018>	Até o Bimestre/ <2017>	Até o Bimestre/ <2018>	Até o Bimestre/ <2017>	Em <2018>	Em <2017>
ADMINISTRAÇÃO (V)	26.576.000,00	26.576.000,00	19.071.830,90	17.812.848,48	16.680.616,40	16.973.017,32	2.391.214,50	839.831,16
Despesas Correntes	19.476.000,00	22.524.138,14	18.183.256,60	16.320.053,96	15.879.262,81	15.548.533,51	2.303.993,79	771.520,45
Despesas de Capital	7.100.000,00	4.051.861,86	888.574,30	1.492.794,52	801.353,59	1.424.483,81	87.220,71	68.310,71
PREVIDÊNCIA (VI)	14.531.000,00	20.574.525,18	19.093.381,45	14.291.246,85	18.622.591,42	14.288.308,86	470.790,03	2.937,99
Benefícios - Civil	9.143.000,00	12.961.219,96	11.265.706,08	8.259.001,59	11.009.194,15	8.259.001,59	256.511,93	
Aposentadorias	9.143.000,00	12.961.219,96	5.851.576,43	3.768.150,09	5.595.064,50	3.768.150,09	256.511,93	
Pensões			5.414.129,65	4.490.851,50	5.414.129,65	4.490.851,50		
Outros Benefícios Previdenciários								
Benefícios - Militar	5.388.000,00	7.539.305,22	7.751.103,67	5.959.245,26	7.536.825,57	5.959.245,26	214.278,10	
Reformas			5.727.430,03	4.410.575,22	5.513.151,93	4.410.575,22	214.278,10	
Pensões	5.388.000,00	7.535.733,52	2.023.673,64	1.547.779,04	2.023.673,64	1.547.779,04		
Outros Benefícios Previdenciários		3.571,70		891,00		891,00		
Outras Despesas Previdenciárias	0	74.000,00	76.571,70	73.000,00	76.571,70	70.062,01		2.937,99
Compensação Previdenciária do RPPS para o RGPS								
Demais Despesas Previdenciárias		74.000,00	76.571,70	73.000,00	76.571,70	70.062,01		2.937,99
TOTAL DAS DESPESAS PREVIDENCIÁRIAS RPPS (VII) = (V + VI)	41.107.000,00	47.150.525,18	38.165.212,35	32.104.095,82	35.303.207,33	31.261.326,18	2.862.004,53	842.769,15

RESULTADO PREVIDENCIÁRIO (VIII) = (IV - VII)² | 387.197.000,00 | 381.153.474,82 | 600.445.235,48 | 366.903.452,95 | 603.307.240,01 | 367.746.222,10 | 635.748.443,30 | 398.164.779,13

RECURSOS RPPS ARRECADADOS EM EXERCÍCIOS ANTERIORES | VALOR | PREVISÃO ORÇAMENTÁRIA | 3.099.568.341,20

RESERVA ORÇAMENTÁRIA DO RPPS | VALOR | PREVISÃO ORÇAMENTÁRIA | 387.197.000,00

APORTES DE RECURSOS PARA O PLANO PREVIDENCIÁRIO DO RPPS | APORTES REALIZADOS

Plano de Amortização - Contribuição Patronal Suplementar
 Plano de Amortização - Aporte Periódico de Valores Predefinidos
 Outros Aportes para o RPPS
 Recursos para Cobertura de Déficit Financeiro

BENS E DIREITOS DO RPPS	PERÍODO DE REFERÊNCIA	
	<2018>	<2017>
Caixa e Equivalentes de Caixa		
Investimentos e Aplicações	3.362.469.986,06	2.698.111.825,89
Outros Bens e Direitos	799.143.774,86	659.059.593,78

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao exercício de 2019, destacando:

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 03 a 04)
- 2) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Poder Executivo, apresentando os saldos e **performance** dos Fundos de Investimentos, evolução dos saldos dos Fundos de Investimentos, imóveis e CVS, comparativo da rentabilidade com a Meta Atuarial, Evolução e variação dos recursos do FPREV Executivo (páginas 05 a 11)
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 11 a 13)
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (página 13)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (página 14 a 15)
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (página 18)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (páginas 16 a 17)
- 8) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado – FPREV (página 18)
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro: Executivo, DPE, ALE e MPE – (páginas 19 a 20)
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 20)
- 11) Outros Recursos do Tribunal de Justiça – TJ/AM: Saldos e Composição (páginas 20)
- 12) Outros Recursos Tribunal de Contas do Estado - TCE: Saldos e Composição (página 21)
- 13) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 22 a 25)
- 14) Total consolidado e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 26 a 27)
- 15) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 28)
- 16) Relatório de Risco dos Ativos (páginas 29 a 32).
- 17) Verificação de Lastro dos Fundos de Risco de Crédito (página 34)
- 18) Parecer do Comitê de Investimentos (página 35).
- 19) Aprovação do Conselho Fiscal (página 36).

1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

Registrado pelo Relatório Síntese Econômica de Dezembro/19, emitido pela BRAM Asset Management.

No Brasil, o Comitê de Política Monetária (Copom) reduziu a taxa Selic pela 4ª vez consecutiva e novos ajustes dependerão da evolução da atividade econômica. Em decisão unânime, a Selic passou de 5,0% para 4,5% a.a., conforme o esperado. Em sua comunicação, o Banco Central (BC) preferiu não se comprometer com novos cortes na taxa Selic, passando a depender da evolução do cenário. Os membros reforçaram a avaliação de que o processo de recuperação da economia ganhou tração e que esse seguirá em ritmo gradual. A inflação e os seus núcleos seguem em níveis confortáveis, bem como as expectativas ancoradas. Ademais, alguns membros avaliam que os últimos dados de atividade e a maior eficiência no mercado de crédito e capitais podem implicar redução da ociosidade mais rápido do que o esperado, gerando pressão inflacionária. O Copom sugere cautela em eventuais novos ajustes, já que os efeitos da política monetária têm impactos defasados na atividade e nos preços. Por outro lado, as projeções de inflação do BC permaneceram abaixo da meta, mesmo incorporando um câmbio mais depreciado. Com a recuperação da atividade de forma mais consistente, o Copom deverá manter a taxa Selic em 4,5% a.a. ao longo de 2020.

Em termos de dados econômicos, o IPCA-15 acelerou em dezembro com maior pressão em alimentação e administrados. Em dezembro, a prévia da inflação ao consumidor (IPCA-15) subiu 1,05%. Com isso, o indicador encerrou 2019 com alta de 3,9%, abaixo do centro da meta do Banco Central (4,25%). A inflação de dezembro foi pressionada pelos preços de proteínas, somente a carne bovina subiu 18,6% no IPCA-15. Além disso, os preços administrados tiveram alta de 1,0%, após estabilidade em novembro, impulsionados pelo aumento de 37% nos preços das apostas lotéricas. Com esses números, a projeção para o IPCA no ano ficou em 4,2%.

O índice de atividade econômica (IBC-Br) registrou novo aumento em outubro e os dados do ministério do trabalho (CAGED) mostraram a criação líquida de 89 mil vagas formais em novembro. O IBC-Br avançou 0,2% em outubro, refletindo a melhora na indústria (0,8%), comércio ampliado (0,8%) e serviços (0,8%). Além disso, os dados do CAGED mostraram a criação líquida de 89 mil novas vagas em novembro, na série com ajuste sazonal. O cenário de recuperação do emprego formal deverá continuar em dezembro. Os dados reforçam, portanto, a retomada gradual da atividade. A projeção para o crescimento de 2019 é de 1,1%.

Fase 1 do acordo entre China e Estados Unidos reduz incerteza relacionada à guerra comercial. Os EUA e a China chegaram a um acordo em dezembro. A China se comprometeu a comprar US\$ 50

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

bilhões em commodities norte-americanas e os Estados Unidos irão suspender a implementação de novas tarifas de importação (15% sobre US\$ 160 bilhões), programadas para entrar em vigor no dia 15 de dezembro. Outros US\$ 120 bilhões em importações da China terão alíquota reduzida de 15% para 7,5%. Essa 1ª fase de acordo comercial reduz o risco de uma desaceleração global mais intensa e possibilita melhora dos indicadores de confiança.

Nos EUA, o Fed manteve a taxa de juros e sinalizou que seu nível está apropriado para manter o crescimento da economia americana. Na reunião de dezembro, a taxa de juros permaneceu no intervalo entre 1,50% e 1,75% ao ano. Em seu comunicado, a autoridade monetária enfatizou que os dados recentes mostram um mercado de trabalho robusto e a atividade crescendo em ritmo moderado. A dinâmica de inflação nos EUA segue comedida, o que deve permitir que o Fed mantenha a política monetária acomodatória nas próximas reuniões. Em seu discurso, o presidente do Fed, Jerome Powell, enfatizou que é preciso uma mudança material importante para que haja algum movimento de juros, em ambas as direções. Ele afastou qualquer possibilidade de aumento de juros no curto prazo até que haja uma alta persistente da inflação, acima do patamar de 2%. Diante do atual cenário, avaliamos que o Fed deverá manter inalterados os juros ao longo de 2020. O Banco Central Europeu (BCE) manteve inalterada a política monetária estimulativa na 1ª reunião sob o comando de Christine Lagarde. A taxa de depósito foi mantida em -0,5%, a de refinanciamento em 0,0% e a taxa de empréstimo permaneceu em 0,25%. No comunicado, o BCE reforçou que pretende manter as taxas nos níveis atuais, bem como a continuidade de seu programa de recompra de títulos, até que observe uma convergência robusta da inflação a um nível próximo à meta, atualmente estipulada em 2%. Em sua 1ª reunião, a presidente Christine Lagarde prometeu uma revisão das estratégias do BCE em 2020. Em geral, a postura do BCE deve se manter acomodatória, no contexto de desaceleração da atividade na região, que sofre com sua maior exposição ao cenário de incerteza global.

Na China, os dados de atividade superaram as expectativas em novembro. No mês, a indústria cresceu 6,2% na comparação anual, acima da expectativa do mercado (5,0%) e acelerando com relação ao crescimento registrado em outubro (4,7%). As vendas no varejo, por sua vez, aceleraram de 7,2% para 8,0%, acima da expectativa (7,6%). Também na comparação anual, os investimentos em ativos fixos permaneceram estáveis em 5,2% em novembro. Os dados do 4º trimestre seguem compatíveis com crescimento de 5,8% do PIB, abaixo do crescimento obtido no trimestre anterior (6%). As autoridades chinesas seguem adotando medidas pontuais para impulsionar o crescimento. A inflação mais pressionada, por sua vez, tem reduzido o espaço para o estímulo monetário.

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)				
	29/11/2019	31/12/2019	out/19	nov/19	dez/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 230.179.164,62	R\$ 198.018.545,52	0,4576	0,3332	0,3700	1,1652%	5,8351%	5,8351%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 73.707.169,16	R\$ 74.613.002,01	1,6870	(0,3896)	1,2300	2,5367%	12,9193%	12,9193%
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 2.055.612,79	R\$ 2.069.160,48	0,4560	0,3562	0,3500	1,1667%	5,2497%	5,2497%
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 50.003.308,98	R\$ 61.017.937,22	-	0,0066	0,8500	0,8567%	2,4977%	NC
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF	R\$ 44.537.083,42	R\$ 44.884.920,74	0,7369	0,8585	0,7800	2,3943%	8,6292%	8,6292%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 51.949.827,85	R\$ 52.723.442,05	2,3896	(0,9967)	1,4900	2,8795%	17,5142%	17,5142%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 285.353.658,56	R\$ 393.740.760,23	1,7103	(0,5077)	0,5934	1,7944%	16,4296%	16,4296%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 776.796.264,83	R\$ 786.165.139,76	1,6392	(0,3380)	1,2061	2,5174%	12,8536%	12,8536%
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 86.964.406,93	R\$ -	4,6450	(4,3425)	2,5562	2,6595%	29,4898%	29,4898%
SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	R\$ 180.136.637,69	R\$ 182.327.839,97	1,6327	(0,3021)	1,2164	2,5582%	12,8963%	12,8963%
SANTANDER IMA B INST. TP	R\$ 23.434.070,60	R\$ 23.898.291,44	3,3394	(2,5397)	1,9810	2,7100%	7,1540%	NC
SANTANDER RF ATIVO FIC	R\$ -	R\$ 16.944.002,80	-	-	-	0,0000%	0,0000%	0,0000%
BB PREVID TP VII	R\$ 19.649.879,22	R\$ 19.830.095,05	1,0468	0,4337	0,9171	2,4158%	10,4600%	10,4600%
BB PREVID TP IX	R\$ -	R\$ -	0,4570	-	-	0,4570%	4,9354%	4,9354%
BB PREVID IDKA 2	R\$ 820.420.226,62	R\$ 779.347.656,84	1,2387	0,2081	1,1526	2,6187%	11,2024%	11,2024%
BB PREVID RF IMA B5+	R\$ 259.396.230,85	R\$ -	4,6634	(4,1025)	-	0,3696%	26,6060%	26,6060%
BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 9.336.501,90	R\$ 291.404.341,23	0,4570	(0,9380)	0,9588	0,4688%	0,4688%	NC
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 263.213.295,00	R\$ 234.025.458,08	0,4963	0,3475	0,3400	1,1884%	11,9105%	11,9105%
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 12.624.906,17	R\$ 12.771.920,21	1,4935	(0,8602)	1,1600	1,7877%	8,4910%	NC
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 53.450.194,19	R\$ 54.105.864,09	1,6697	(0,3717)	1,2300	2,5377%	8,2137%	NC
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 108.368.462,49	R\$ 111.187.148,23	4,7088	(4,1408)	2,6000	2,9828%	17,8317%	NC
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 63.745.000,02	R\$ 65.173.881,43	3,5229	(2,4994)	2,2400	3,1964%	6,8642%	NC
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 3.415.321.901,89	R\$ 3.404.249.407,38						

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)				
	29/11/2019	31/12/2019	out/19	nov/19	dez/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPH	R\$ 30.887.141,46	R\$ 33.172.203,65	2,6447	0,7310	7,4000	11,0463%	14,9566%	NC
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ -	R\$ 55.151.980,82	-	-	10,4300	10,4300%	10,4300%	NC
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ -	R\$ 53.488.335,31	-	-	6,5217	6,5217%	6,5217%	NC
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO	R\$ 5.914.894,42	R\$ 5.641.186,09	3,0929	2,5428	(4,6274)	0,8225%	4,8155%	4,8155%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 4.978.959,41	R\$ 5.388.337,85	1,7360	3,3085	8,2221	13,7436%	60,9153%	60,9153%
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 71.640.744,59	R\$ 77.237.719,42	1,9064	1,3765	7,8126	11,3802%	32,9177%	32,9177%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 31.360.951,63	R\$ 33.754.891,18	2,3875	1,4955	7,6335	11,8514%	16,3961%	NC
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 63.942.188,09	R\$ 69.231.592,11	2,8561	1,3002	8,2700	12,8102%	35,0520%	35,0520%
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 147.095.561,50	R\$ 162.109.478,81	0,8985	2,9990	10,2100	14,5352%	39,8400%	39,8400%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 138.000.778,68	R\$ 181.100.233,57	2,3832	1,9002	8,1300	12,8106%	36,5497%	NC
SAFRA S&P REAIS	R\$ 12.793.062,36	R\$ 19.241.920,34	2,1148	3,7849	2,6300	8,7670%	31,9874%	31,9874%
SAFRA CONSUMO AMERICANO	R\$ 6.132.936,65	R\$ -	(0,7875)	6,5485	-	5,7094%	15,0569%	NC
ICATU VANGUARDIA DIVIDENDOS FIA	R\$ 251.611.440,77	R\$ 270.514.941,75	1,8671	0,4561	7,5100	10,0168%	42,6149%	42,6149%
ICATU VANGUARDIA AÇÕES IBX FI	R\$ 24.882.120,83	R\$ 26.693.759,15	-	-	7,2800	7,2800%	7,2800%	7,2800%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 62.723.302,30	R\$ 67.233.626,38	2,3404	0,2449	7,1900	9,9674%	39,2284%	39,2284%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 851.964.082,69	R\$ 1.059.960.206,43						

TOTAL GERAL	R\$ 4.267.285.984,58	R\$ 4.464.209.613,81
--------------------	-----------------------------	-----------------------------

Quadro 1.

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

Nota 2: Os Recursos de Contribuição Previdenciária recebidos no período foram direcionados para os fundos Icatu Vanguardia AÇÕES IBX FI e Bradesco FIC FIA IBRX Alpha, conforme registrado na Ata 157/2019

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

COMIV e aprovado pela Diretoria em Despacho de 29/11/2019. Essas movimentações foram efetuadas até o limite estabelecido para Renda Variável na Política de Investimentos, portanto, os demais valores foram alocados em fundo de Gestão Ativa e indexados ao CDI.

Nota 3: Conforme registrado em Ata de Reunião extraordinária, em 27/12/2019, a Diretoria aprovou em 06/12/2019, migrar os valores aplicados nos fundos Caixa FI Brasil IMA B5+ e BB Previdenciário IM B5+ para os fundos Caixa BR Gestão Estratégica e BB Previdenciário RF Alocação Ativa.

Nota 4: Os recursos aplicados no fundo Safra Consumo Americano miraram para o fundo Safra S&P 500 Reais, registrado na Ata 157/2019 COMIV e aprovado pela Diretoria em Despacho de 29/11/2019.

Nota 5: Efetuadas as aplicações iniciais nos fundos Bradesco FI Ações Small Cap Plus e BB Previdenciário Ações Valor FIC FIA, registrados na Ata 156/2019.

Nota 6: Conforme aprovado pela Diretoria, com base na Ata 157/2019, foi aplicado o valor inicial de R\$ 50 milhões no fundo BB Prev Ações Valor FIC FIA, utilizando os recursos do fundo BB Prev IDKA 2.

2.2 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXECUTIVO

INSTITUIÇÃO	out/19	nov/19	dez/19
BRADESCO	R\$ 366.689.708,04	R\$ 386.832.397,01	R\$ 424.042.829,70
BANCO DO BRASIL	R\$ 1.118.199.574,85	R\$ 1.108.802.838,59	R\$ 1.144.070.428,43
CAIXA	R\$ 1.264.174.752,30	R\$ 1.256.495.095,42	R\$ 1.288.543.786,72
ITAÚ	R\$ 603.660.064,48	R\$ 612.251.823,27	R\$ 646.466.762,57
SANTANDER	R\$ 306.276.945,78	R\$ 306.572.404,51	R\$ 334.162.744,81
ICATU/BEM DTVM	R\$ 423.875.221,86	R\$ 450.937.124,45	R\$ 475.273.633,43
SAFRA	R\$ 83.461.604,85	R\$ 82.670.999,03	R\$ 84.415.801,77
BTG PACTUAL	R\$ 62.570.039,57	R\$ 62.723.302,30	R\$ 67.233.626,38
TOTAL	R\$ 4.228.907.911,73	R\$ 4.267.285.984,58	R\$ 4.464.209.613,81

Quadro 2.

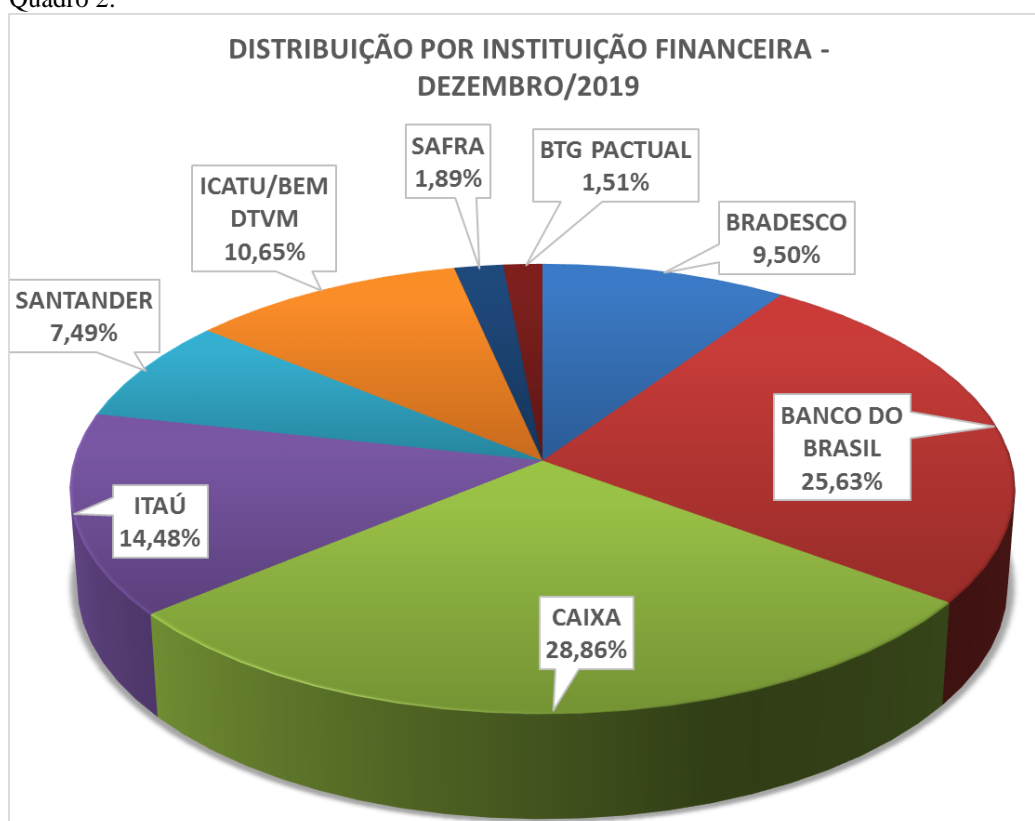


Gráfico 1

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

2.3 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA

FUNDO DE INVESTIMENTO	ÍNDICE DE REFERÊNCIA	SALDO POR FUNDO	SALDO APLICADO	% APLICADO
BRASESCO FI REFER DI PREMIUM	CDI	R\$ 198.018.545,52	R\$ 200.087.706,00	4,48%
BRASESCO FI MAXI PODER PUBLICO		R\$ 2.069.160,48		
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	CDI ATIVO	R\$ 393.740.760,23	R\$ 1.016.374.419,90	22,77%
BB PREVID ALOCAÇÃO ATIVA		R\$ 291.404.341,23		
SAFRA CONSUMO AMERICANO		R\$ -		
SAFRA S&P REAIS		R\$ 19.241.920,34		
BRASESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA		R\$ 61.017.937,22		
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI		R\$ 234.025.458,08		
SANTANDER RF ATIVO FIC		R\$ 16.944.002,80		
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	IMA B	R\$ 65.173.881,43	R\$ 89.072.172,87	2,00%
SANTANDER IMA B INST. TP		R\$ 23.898.291,44		
BRASESCO INST. FIC FI RF IMA B5	IMA B 5	R\$ 74.613.002,01	R\$ 1.109.983.766,04	24,86%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP		R\$ 786.165.139,76		
ICATU VANG. FI RF INFLA. CP		R\$ 12.771.920,21		
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF		R\$ 54.105.864,09		
SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF		R\$ 182.327.839,97		
BB PREVID IDKA 2 TP RF	IDKA 2	R\$ 779.347.656,84	R\$ 779.347.656,84	17,46%
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	IMA B 5+	R\$ -	R\$ 111.187.148,23	2,49%
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF		R\$ 111.187.148,23		
BB PREVID RF IMA B5+		R\$ -		
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF	IPCA + 6%	R\$ 44.884.920,74	R\$ 117.438.457,84	2,63%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF		R\$ 52.723.442,05		
BB PREVID TP VII		R\$ 19.830.095,05		
BB PREVID TP IX		R\$ -		
BRASESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	IBR X	R\$ 33.172.203,65	R\$ 59.865.962,80	1,34%
ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI		R\$ 26.693.759,15		
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES	IBOVESPA	R\$ 77.237.719,42	R\$ 980.852.323,29	21,97%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES		R\$ 33.754.891,18		
BRASESCO FIA MID SMALL CAPS		R\$ 55.151.980,82		
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA		R\$ 53.488.335,31		
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA		R\$ 69.231.592,11		
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI		R\$ 162.109.478,81		
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO		R\$ 5.641.186,09		
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES		R\$ 5.388.337,85		
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA		R\$ 270.514.941,75		
BTG ABSOLUTO FIQ FIA		R\$ 67.233.626,38		
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC		R\$ 181.100.233,57		
TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO		R\$ 4.464.209.613,81	R\$ 4.464.209.613,81	100%

Quadro 3

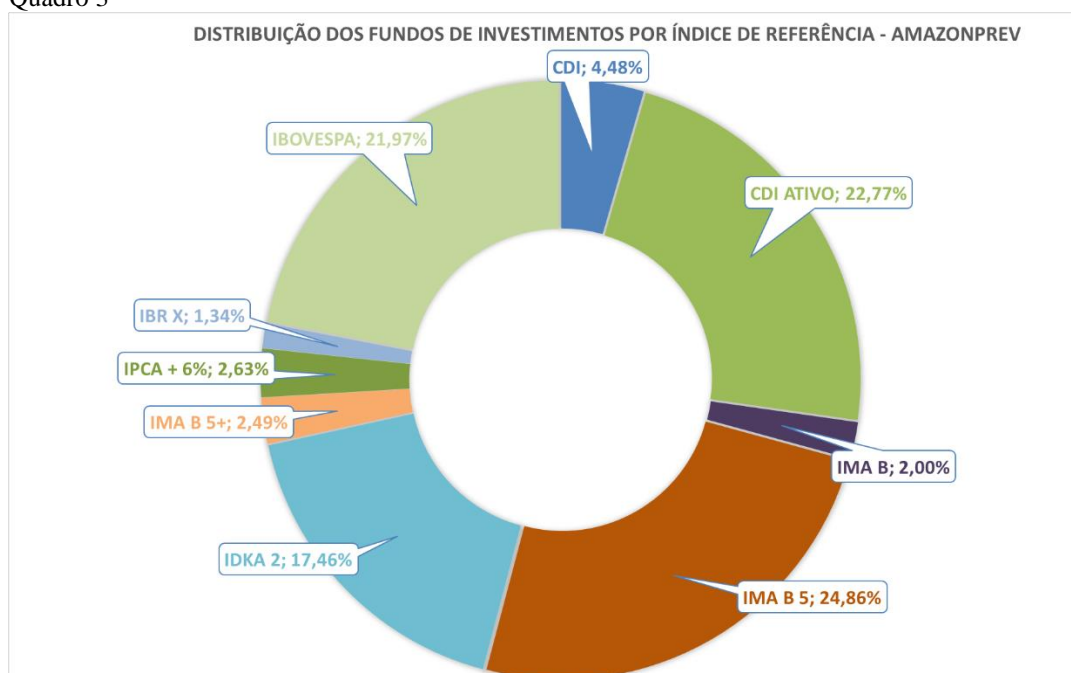


Gráfico 2.

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

2.4 COMPARATIVO DA VALORIZAÇÃO DOS ÍNDICES DE REFERÊNCIA DE MERCADO

ÍNDICE	dez/19	2019	12 MESES
CDI	0,3800%	5,9700%	5,9700%
IMA-B 5	1,2352%	13,1542%	13,1542%
IMA-B	2,0056%	22,9504%	22,9504%
IMA B 5+	2,6036%	30,3689%	30,3689%
IRF M 1	0,4187%	6,7591%	6,7591%
IDKA 2	1,2030%	11,8225%	11,8225%
IBOVESPA	6,8500%	31,5800%	31,5800%

Quadro 4.

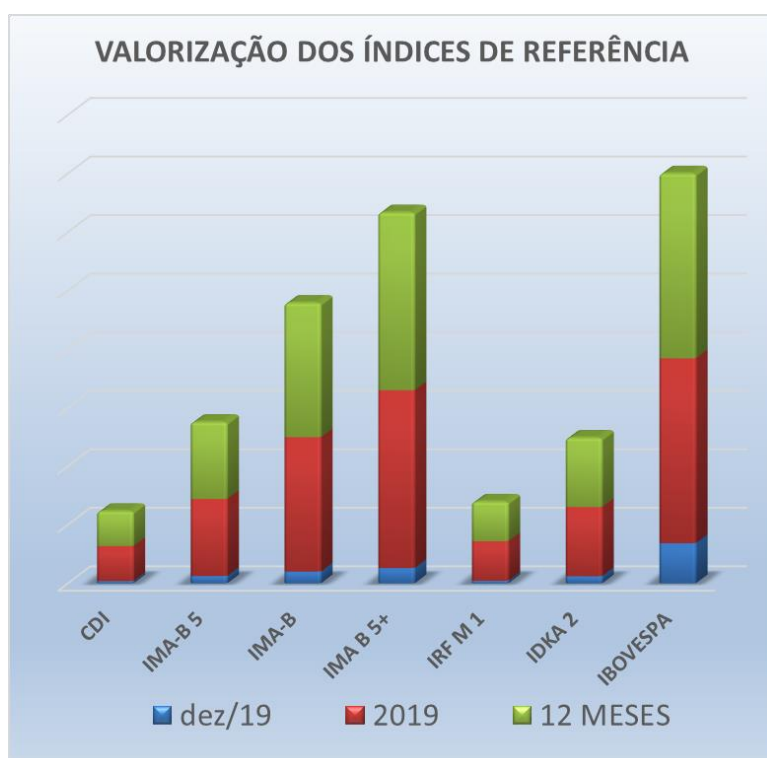


Gráfico 3.

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/11/2019	31/12/2019	out/19	nov/19	dez/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 149.979.150,59	R\$ 152.499.743,65	0,625121	1,037272	1,680629	3,3776%	11,0651%	11,0651%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 155.934.087,94	R\$ 158.569.619,48	0,634550	1,046740	1,690157	3,4066%	11,1900%	11,1900%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 159.152.748,43	R\$ 161.880.612,44	0,658137	1,070423	1,713991	3,4793%	11,5032%	11,5032%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 161.544.395,00	R\$ 164.274.775,25	0,634566	1,046756	1,690173	3,4067%	11,1902%	11,1902%
TOTAL GERAL	R\$ 626.610.381,96	R\$ 637.224.750,82						

Quadro 5.

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

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

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

2.6 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
TIPO DE ATIVO	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B
INTERMEDIÁRIO	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO
PREÇO UNITÁRIO DE COMPRA	R\$ 2.314,742871	R\$ 2.288,539269	R\$ 2.235,637189	R\$ 2.254,343911
QUANTIDADE	43.100	43.450	44.113	44.350
APLICAÇÃO INICIAL	R\$ 99.765.417,74	R\$ 99.437.031,23	R\$ 98.620.663,31	R\$ 99.980.152,45
VALOR ATUAL	R\$ 152.499.743,65	R\$ 158.569.619,48	R\$ 161.880.612,44	R\$ 164.274.775,25
DATA DE EMISSÃO	15/01/2014	10/02/2010	10/02/2010	10/02/2010
DATA DA APLICAÇÃO	15/01/2014	15/01/2014	29/01/2014	15/01/2014
DATA DO RESGATE	15/05/2023	15/08/2030	15/08/2030	15/08/2040
TAXA DE JUROS CONTRATADA	6,48%	6,5998%	6,90%	6,60%

Quadro 6.

2.7 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	29/11/2019	31/12/2019
CVS - A	R\$ 1.484.345,94	R\$ 1.466.892,62
CVS - B	R\$ 9.604.713,90	R\$ 9.491.736,10
CVS - C	R\$ 192.552,36	R\$ 190.288,28
CVS - D	R\$ 1.053.284,76	R\$ 1.040.895,24
TOTAL	R\$ 12.334.896,96	R\$ 12.189.812,24

Quadro 7.

2.8 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/19	R\$ 40.326,42	R\$ 145.084,72	R\$ 185.411,14
fev/19	R\$ 39.906,45	R\$ 145.084,72	R\$ 184.991,17
mar/19	R\$ 39.486,47	R\$ 145.084,72	R\$ 184.571,19
abr/19	R\$ 39.066,51	R\$ 145.084,72	R\$ 184.151,23
mai/19	R\$ 38.646,54	R\$ 145.084,72	R\$ 183.731,26
jun/19	R\$ 38.226,55	R\$ 145.084,72	R\$ 183.311,27
jul/19	R\$ 37.806,59	R\$ 145.084,72	R\$ 182.891,31
ago/19	R\$ 37.386,62	R\$ 145.084,72	R\$ 182.471,34
set/19	R\$ 36.966,64	R\$ 145.084,72	R\$ 182.051,36
out/19	R\$ 36.546,68	R\$ 145.084,72	R\$ 181.631,40
nov/19	R\$ 36.126,70	R\$ 145.084,72	R\$ 181.211,42
dez/19	R\$ 35.706,73	R\$ 145.084,72	R\$ 180.791,45
TOTAL	R\$ 456.198,90	R\$ 1.741.016,64	R\$ 2.197.215,54

Quadro 8.

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

2.9 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2019 (Contrato Regular)			
MÊS	UEA	SEAS	TOTAL
jan/19	R\$ -	R\$ -	R\$ -
fev/19	R\$ -	R\$ -	R\$ -
mar/19	R\$ 116.361,92	R\$ 267.638,40	R\$ 384.000,32
abr/19	R\$ 58.180,96	R\$ -	R\$ 58.180,96
mai/19	R\$ 58.180,96	R\$ -	R\$ 58.180,96
jun/19	R\$ 116.361,92	R\$ 267.638,40	R\$ 384.000,32
jul/19	R\$ -	R\$ 267.638,40	R\$ 267.638,40
ago/19	R\$ 58.180,96	R\$ -	R\$ 58.180,96
set/19	R\$ 58.180,96	R\$ 133.819,20	R\$ 192.000,16
out/19	R\$ 40.067,12	R\$ 133.819,20	R\$ 173.886,32
nov/19	R\$ 53.422,83	R\$ -	R\$ 53.422,83
dez/19	R\$ 174.542,88	R\$ 267.638,40	R\$ 442.181,28
TOTAL	R\$ 733.480,51	R\$ 1.338.192,00	R\$ 2.071.672,51

Quadro 9.

2.10 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	29/11/2019	31/12/2019	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.267.285.984,58	R\$ 4.464.209.613,81	86,28%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 626.610.381,96	R\$ 637.224.750,82	12,32%
TÍTULOS CVS	R\$ 12.334.896,96	R\$ 12.189.812,24	0,24%
IMÓVEIS	R\$ 62.060.000,00	R\$ 60.353.005,55	1,17%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -	0,00%
TOTAL	R\$ 4.968.291.263,50	R\$ 5.173.977.182,42	100%

Quadro 10.

2.11 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS – FPREV EXECUTIVO

Mês	Recursos FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
dez/18	R\$ 4.052.222.964,81	2,88%	20,98%	20,98%
jan/19	R\$ 4.144.928.828,18	2,29%	2,29%	20,76%
fev/19	R\$ 4.198.622.173,30	1,30%	3,61%	20,77%
mar/19	R\$ 4.270.610.204,33	1,71%	5,39%	20,79%
abr/19	R\$ 4.340.813.251,38	1,64%	7,12%	21,39%
mai/19	R\$ 4.441.433.234,67	2,32%	9,60%	24,70%
jun/19	R\$ 4.560.478.660,06	2,68%	12,54%	26,72%
jul/19	R\$ 4.650.607.110,06	1,98%	14,77%	25,75%
ago/19	R\$ 4.698.765.985,21	1,04%	15,96%	25,85%
set/19	R\$ 4.814.401.867,02	2,46%	18,81%	26,83%
out/19	R\$ 4.927.631.461,93	2,35%	21,60%	26,59%
nov/19	R\$ 4.968.291.263,50	0,83%	22,61%	26,14%
dez/19	R\$ 5.173.977.182,42	4,14%	27,68%	27,68%

Quadro 11.

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

2.12 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo do Amazonas - EXECUTIVO2019

13/01/2020 17:02:45

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 31/12/2019	
		Saldo Financeiro em 31/12/2018	4.052.222.964,81
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
01/2019	25.741.140,15	1.624.312,33	24.116.827,82
02/2019	36.105.221,68	1.577.166,50	34.528.055,18
03/2019	48.780.707,02	1.653.421,67	47.127.285,35
04/2019	27.254.847,98	1.484.969,43	25.769.878,55
05/2019	37.682.513,87	1.872.658,21	35.809.855,66
06/2019	41.150.382,45	1.842.441,88	39.307.940,57
07/2019	38.725.793,39	2.036.530,69	36.689.262,70
08/2019	39.885.991,44	1.920.723,93	37.965.267,51
09/2019	41.301.229,85	1.811.278,88	39.489.950,97
10/2019	40.858.104,23	2.023.186,58	38.834.917,65
11/2019	40.805.162,75	889.103,33	39.916.059,42
12/2019	80.878.067,28	1.824.810,55	79.053.256,73
		Saldo Financeiro em 31/12/2019	5.173.977.182,42
Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos			
Taxa de Juros Anual:	6,0000 %	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	4,3060 %	4,3060 %	1,1500 %
Juros	6,0000 %	6,0000 %	0,4868 %
Meta	10,5644 %	10,5644 %	1,6424 %
Rentabilidade %	15,1734 %	15,1734 %	2,5488 %
Rentabilidade R\$	643.145.659,50	643.145.659,50	126.632.662,19
Resultado %	+4,1686 %	+4,1686 %	+0,8918 %
Resultado R\$	+195.201.772,59	+195.201.772,59	+45.035.794,51

Quadro 12.

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

Quadro 13.

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	29/11/2019	30/12/2019	out/19	nov/19	dez/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 4.743.372,71	R\$ 4.771.519,61	1,7103	(0,5077)	0,5934	1,7944%	16,4326%	16,4326%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 4.606.239,54	R\$ 4.622.073,10	0,4963	0,3475	0,3400	1,1884%	6,9110%	NC
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 555.192,48	R\$ 596.903,95	1,8671	0,4561	7,5100	10,0168%	11,3885%	NC
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 116.604,44	R\$ 235.230,61	-	-	1,1600	1,1600%	1,1600%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 10.021.409,17	R\$ 10.225.727,27						

Quadro 14.

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

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/11/2019	30/12/2019	out/19	nov/19	dez/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.129.358,31	R\$ 2.165.347,82	0,634550	1,046740	1,690157	3,4066%	11,1900%	11,1900%
TOTAL GERAL	R\$ 2.129.358,31	R\$ 2.165.347,82						

Quadro 15.

3.3 Composição dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS - ALE FPREV	set/19	out/19	nov/19	dez/19
SALDO ANTERIOR	11.456.007,59	11.774.465,04	12.017.646,25	12.150.767,48
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	115.124,97	117.675,84	116.604,44	116.605,44
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	203.332,48	125.505,37	16.516,79	123.702,17
SAÍDAS FINANCEIRAS	-	-	-	-
SALDO FINAL	11.774.465,04	12.017.646,25	12.150.767,48	12.391.075,09

Quadro 16.

3.4 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	29/11/2019	31/12/2019
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 10.021.409,17	R\$ 10.225.727,27
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.129.358,31	R\$ 2.165.347,82
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 12.150.767,48	R\$ 12.391.075,09

Quadro 17.

3.5 Evolução dos Recursos – ALE/FPREV

Mês	Recursos ALE FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
dez/18	R\$ 9.650.491,60	4,91%	27,41%	27,41%
jan/19	R\$ 10.037.031,39	4,01%	4,01%	28,94%
fev/19	R\$ 10.201.534,98	1,64%	5,71%	28,95%
mar/19	R\$ 10.372.018,29	1,67%	7,48%	28,87%
abr/19	R\$ 11.181.920,91	7,81%	15,87%	35,97%
mai/19	R\$ 10.907.257,42	-2,46%	13,02%	33,82%
jun/19	R\$ 11.207.199,38	2,75%	16,13%	35,83%
jul/19	R\$ 11.373.542,16	1,48%	17,85%	33,46%
ago/19	R\$ 11.456.007,59	0,73%	18,71%	32,37%
set/19	R\$ 11.774.465,04	2,78%	22,01%	30,94%
out/19	R\$ 12.017.646,25	2,07%	24,53%	33,35%
nov/19	R\$ 12.150.767,48	1,11%	25,91%	32,09%
dez/19	R\$ 12.391.075,09	1,98%	28,40%	28,40%

Quadro 18.

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

3.6 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo do Amazonas - ASSEMBLEIA2019

13/01/2020 16:59:30

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 31/12/2019	
		Saldo Financeiro em 31/12/2018	9.650.491,60
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
01/2019	239.632,65	0,00	239.632,65
02/2019	108.995,36	0,00	108.995,36
03/2019	108.995,35	0,00	108.995,35
04/2019	118.011,62	0,00	118.011,62
05/2019	115.170,24	0,00	115.170,24
06/2019	114.154,91	0,00	114.154,91
07/2019	0,00	0,00	0,00
08/2019	116.326,93	0,00	116.326,93
09/2019	115.124,97	0,00	115.124,97
10/2019	117.675,84	0,00	117.675,84
11/2019	116.604,44	0,00	116.604,44
12/2019	116.912,84	0,00	116.912,84
		Saldo Financeiro em 31/12/2019	12.391.075,09

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual:	6,0000 %	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	4,3060 %	4,3060 %	1,1500 %
Juros	6,0000 %	6,0000 %	0,4868 %
Meta	10,5644 %	10,5644 %	1,6424 %
Rentabilidade %	13,0980 %	13,0980 %	1,0155 %
Rentabilidade R\$	1.352.978,34	1.352.978,34	123.394,77
Resultado %	+2,2915 %	+2,2915 %	-0,6167 %
Resultado R\$	+261.460,78	+261.460,78	-76.163,69

Quadro 19.

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

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/11/2019	30/12/2019	out/19	nov/19	dez/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 46.088.187,21	R\$ 47.830.964,32	1,9081	(0,9463)	0,8500	1,8018%	9,0595%	NC
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+	R\$ 12.679.091,44	R\$ 13.024.126,05	4,6634	(4,1025)	2,7212	3,1009%	6,0794%	NC
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 80.668.922,46	R\$ 81.598.729,42	1,2387	0,2081	1,1526	2,6187%	4,1224%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 3.118,26						
TOTAL	R\$ 139.436.201,11	R\$ 142.456.938,05						

Quadro 20.

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo do Amazonas - PGJMP2019

13/01/2020 17:04:16

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 31/12/2019	
		Saldo Financeiro em 31/12/2018	99.352.766,72
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
01/2019	0,00	0,00	0,00
02/2019	0,00	0,00	0,00
03/2019	0,00	0,00	0,00
04/2019	0,00	0,00	0,00
05/2019	0,00	0,00	0,00
06/2019	10.130.614,70	0,00	10.130.614,70
07/2019	4.683.054,25	14.095,87	4.668.958,38
08/2019	4.661.168,61	0,00	4.661.168,61
09/2019	6.692.727,22	0,00	6.692.727,22
10/2019	3.644.592,21	17.678,19	3.626.914,02
11/2019	1.219.736,18	15.030,00	1.204.706,18
12/2019	1.375.656,88	0,00	1.375.656,88
		Saldo Financeiro em 31/12/2019	142.456.938,05

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual:	6,0000 %	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	4,3060 %	4,3060 %	1,1500 %
Juros	6,0000 %	6,0000 %	0,4868 %
Meta	10,5644 %	10,5644 %	1,6424 %
Rentabilidade %	9,7675 %	9,7675 %	1,1798 %
Rentabilidade R\$	10.743.425,34	10.743.425,34	1.645.080,06
Resultado %	-0,7207 %	-0,7207 %	-0,4551 %
Resultado R\$	-873.988,15	-873.988,15	-644.954,21

Quadro 21.

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

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/11/2019	31/12/2019	out/19	nov/19	dez/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 9.077.744,67	R\$ 9.189.306,67	1,6870	(0,3896)	1,2300	2,5367%	5,5787%	NC
BRASESCO INST. ALOC. DINAMICA	R\$ 778.376,35	R\$ 3.267.102,47	-	(0,3291)	0,8500	0,5181%	0,5181%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	-	-						
TOTAL	R\$ 9.856.121,02	R\$ 12.456.409,14						

Quadro 22.

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo do Amazonas - DEFENSORIA2019

13/01/2020 17:01:11

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 31/12/2019	
		Saldo Financeiro em 31/12/2018	2.441.450,05
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
01/2019	0,00	0,00	0,00
02/2019	610.322,80	0,00	610.322,80
03/2019	627.819,72	0,00	627.819,72
04/2019	637.839,76	0,00	637.839,76
05/2019	648.474,00	0,00	648.474,00
06/2019	664.320,93	0,00	664.320,93
07/2019	683.371,79	0,00	683.371,79
08/2019	775.936,11	0,00	775.936,11
09/2019	779.947,37	0,00	779.947,37
10/2019	784.381,09	0,00	784.381,09
11/2019	780.946,33	0,00	780.946,33
12/2019	2.476.831,17	0,00	2.476.831,17
		Saldo Financeiro em 31/12/2019	12.456.409,14
Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos			
Taxa de Juros Anual:	6,0000 %	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	4,3060 %	4,3060 %	1,1500 %
Juros	6,0000 %	6,0000 %	0,4868 %
Meta	10,5644 %	10,5644 %	1,6424 %
Rentabilidade %	10,0369 %	10,0369 %	1,2526 %
Rentabilidade R\$	544.768,02	544.768,02	123.456,95
Resultado %	-0,4771 %	-0,4771 %	-0,3835 %
Resultado R\$	-28.298,16	-28.298,16	-38.415,32

Quadro 23.

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

6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/11/2019	31/12/2019	out/19	nov/19	dez/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 17.248.921,31	R\$ 22.151.234,44	1,6870	(0,3896)	1,2300	2,5367%	6,2161%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 17.248.921,31	R\$ 22.151.234,44						

Quadro 24.

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

6.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo do Amazonas - TRIBUNALDEJUSTICA2019

13/01/2020 17:07:07

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 31/12/2019	
		Saldo Financeiro em 31/12/2018	0,00
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
01/2019	0,00	0,00	0,00
02/2019	0,00	0,00	0,00
03/2019	1.124.231,98	0,00	1.124.231,98
04/2019	1.129.159,87	0,00	1.129.159,87
05/2019	1.132.493,24	0,00	1.132.493,24
06/2019	1.138.021,63	241.430,62	896.591,01
07/2019	2.565.437,98	291.519,39	2.273.918,59
08/2019	3.884.077,90	67.916,92	3.816.160,98
09/2019	2.508.252,24	494.376,53	2.013.875,71
10/2019	2.781.927,34	277.820,43	2.504.106,91
11/2019	2.561.139,60	248.791,25	2.312.348,35
12/2019	5.065.716,87	398.911,86	4.666.805,01
		Saldo Financeiro em 31/12/2019	22.151.234,44

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual:	6,0000 %	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	4,3060 %	4,3060 %	1,1500 %
Juros	6,0000 %	6,0000 %	0,4868 %
Meta	10,5644 %	10,5644 %	1,6424 %
Rentabilidade %	4,7217 %	4,7217 %	1,3653 %
Rentabilidade R\$	281.542,79	281.542,79	235.508,12
Resultado %	-5,2844 %	-5,2844 %	-0,2725 %
Resultado R\$	-339.076,75	-339.076,75	-47.780,01

Quadro 25.

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

7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/11/2019	30/12/2019	out/19	nov/19	dez/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 3.260.451,82	R\$ 3.506.553,79	1,6870	(0,3896)	1,2300	2,5367%	4,1037%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	-	-						
TOTAL	R\$ 3.260.451,82	R\$ 3.506.553,79						

Quadro 26.

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

7.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo do Amazonas - TRIBUNALDECONTAS2019

13/01/2020 17:05:40

Fundo Previdenciário		Cálculo Posicionado em 31/12/2019	
		Saldo Financeiro em 31/12/2018	
		0,00	
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
01/2019	0,00	0,00	0,00
02/2019	0,00	0,00	0,00
03/2019	0,00	0,00	0,00
04/2019	0,00	0,00	0,00
05/2019	0,00	0,00	0,00
06/2019	446.815,11	0,00	446.815,11
07/2019	449.663,70	0,00	449.663,70
08/2019	456.011,93	0,00	456.011,93
09/2019	526.068,24	0,00	526.068,24
10/2019	447.922,04	0,00	447.922,04
11/2019	889.854,89	0,00	889.854,89
12/2019	205.915,34	0,00	205.915,34
		Saldo Financeiro em 31/12/2019	3.506.553,79

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos			
Taxa de Juros Anual:	6,0000 %	Índice de Inflação:	IPCA
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	4,3060 %	4,3060 %	1,1500 %
Juros	6,0000 %	6,0000 %	0,4868 %
Meta	10,5644 %	10,5644 %	1,6424 %
Rentabilidade %	10,3290 %	10,3290 %	1,2325 %
Rentabilidade R\$	84.302,54	84.302,54	40.186,63
Resultado %	-0,2129 %	-0,2129 %	-0,4032 %
Resultado R\$	-1.860,00	-1.860,00	-13.361,49

Quadro 27.

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

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

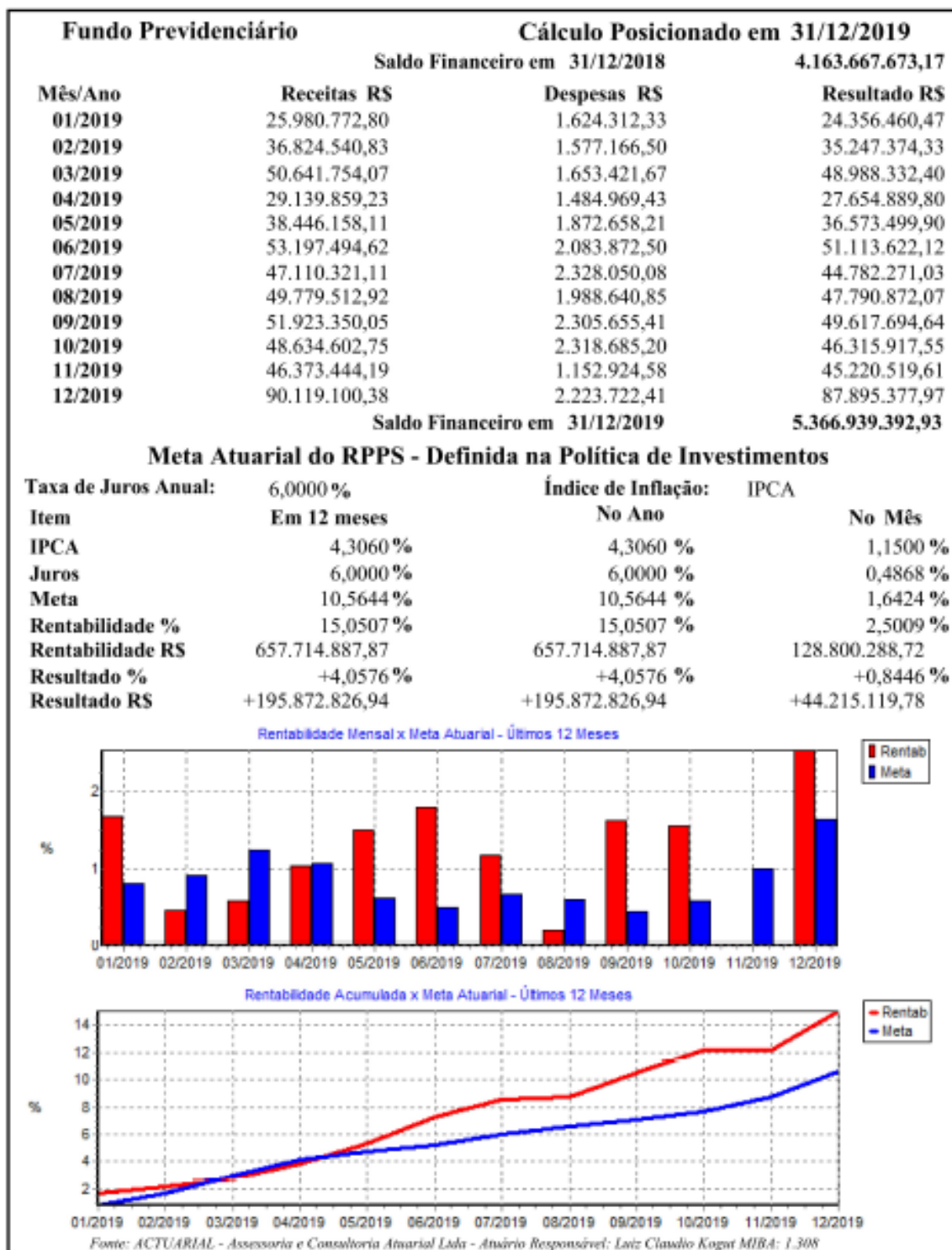
8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV



Estimativa da Rentabilidade pela Movimentação Financeira

Cliente: Governo do Amazonas - CONSOLIDADO2019

13/01/2020 17:08:40



Quadro 28.

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

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

9. RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	29/11/2019	31/12/2019
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	35.646.812,27	6.169.425,02
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	-	29.697.707,36
BRADESCO FIC FI RF ALOC. DINÂMICA - COMPREV	R\$ 3.908.443,57	R\$ 3.941.552,96
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ -	R\$ -
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 33.489,10	R\$ 34.976,25
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 207.615,53	R\$ 191.308,78
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 770,00	R\$ -
TOTAL	R\$ 39.797.130,47	R\$ 40.034.970,37

Quadro 29.

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

Nota 2: O saldo de Cobertura do Déficit refere-se aos valores pendentes de Consignação sobre as folhas de aposentados e pensionistas, já regularizados em janeiro/2020.

Nota 3: Em decorrência da mudança no calendário de pagamentos de inativos e pensionistas para o início do mês subsequente, os valores recebidos são mantidos em fundo de curto prazo e indexados ao CDI.

9.2 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	29/11/2019	31/12/2019
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 291.170,00	R\$ 456.851,77
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 291.170,00	R\$ 456.851,77

Quadro 30.

9.3 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	29/11/2019	31/12/2019
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 377.517,95	R\$ 208.719,44
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 377.518,95	R\$ 208.720,44

Quadro 31.

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

9.4 Composição do Recursos – ALE FFIN

DESCRIÇÃO	out/19	nov/19	dez/19
SALDO ANTERIOR	R\$ 277.172,34	R\$ 207.344,82	R\$ 377.518,95
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	R\$ 935.792,49	R\$ 909.931,15	R\$ 1.157.020,68
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ 1.439.142,00	R\$ 988.062,80	R\$ 2.720.427,93
VARIAÇÃO FINANCEIRA	R\$ 2.030,81	R\$ 1.195,61	R\$ 1.546,01
(-) SAIDAS FINANCEIRAS	-R\$ 2.446.792,82	-R\$ 1.729.015,43	-R\$ 4.047.793,13
SALDO FINAL	R\$ 207.344,82	R\$377.518,95	R\$ 208.720,44

Quadro 32.

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	29/11/2019	31/12/2019
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 754.335,47	R\$ 388.158,17
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ 187.418,23	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 941.753,70	R\$ 388.159,17

Quadro 33.

10. TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/11/2019	31/12/2019	out/19	nov/19	dez/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.261.540,10	R\$ 364.957,98	0,4560	0,3562	0,3500	1,1667%	5,6859%	5,6859%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 41.367.207,38	R\$ 40.759.574,94	1,7103	(0,5077)	0,5934	1,7944%	5,3959%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 1,00						
TOTAL	R\$ 43.628.747,48	R\$ 41.124.533,92						

Quadro 34.

Nota: Utilizados os recursos do fundo Caixa FIC Brasil Gestão estratégica para pagamentos de despesas com custeio administrativo, registrado através do Ofício nº. 5.639/2019.

10.2 Taxa de Administração - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/11/2019	31/12/2019	out/19	nov/19	dez/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 758.006,64	R\$ 799.940,92	0,4560	0,3562	0,3500	1,1667%	5,6858%	5,6858%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 0,00	R\$ -						
TOTAL	R\$ 758.006,64	R\$ 799.940,92						

Quadro 35.

10.3 Taxa de Administração - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/11/2019	31/12/2019	out/19	nov/19	dez/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 256.257,43	R\$ 328.741,68	0,4560	0,3562	0,3500	1,1667%	1,1667%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	-	-						
TOTAL	R\$ 256.257,43	R\$ 328.741,68						

Quadro 36.

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

11. OUTROS RECURSOS

11.1 Tribunal de Justiça do Estado - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	29/11/2019	30/12/2019	out/19	nov/19	dez/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO FI REF. DI PREMIUM	R\$ 23.938.775,14	R\$ -	-	-	-	0,0000%	0,0000%	0,0000%
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ 19.013.987,59	-	-	-	0,0000%	0,0000%	0,0000%
CAIXA FI BRASIL IRF M1 TP RF - TJA	R\$ 185.313.791,06	R\$ 186.059.516,72	0,6068	0,3144	0,4024	1,3292%	6,5520%	6,5520%
BB PREV. RF IRF M1 - TJA	R\$ 181.265.354,27	R\$ 181.985.690,21	0,5987	0,3068	0,3973	1,3083%	6,4922%	6,4922%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 1,00						
TOTAL	R\$ 390.517.920,47	R\$ 387.059.195,52						

Quadro 37.

11.2 Composição dos Saldos - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	out/19	nov/19	dez/19
SALDO ANTERIOR	397.718.758,37	393.179.474,17	390.517.920,47
CONTRIB. PREVIDENCIÁRIA	5.545.375,90	5.671.046,97	11.059.829,84
VARIAÇÃO FINANCEIRA	903.334,51	1.194.740,16	1.541.918,38
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(10.987.994,61)	(9.527.340,83)	(16.060.473,17)
SALDO FINAL	R\$ 393.179.474,17	R\$ 390.517.920,47	R\$ 387.059.195,52

Quadro 38.

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

11.3 Tribunal de Contas do Estado - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	29/11/2019	30/12/2019	out/19	nov/19	dez/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO FI REF. DI PREMIUM	R\$ 7.799.796,42	R\$ -	-	-	-	0,0000%	0,0000%	0,0000%
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ 672.131,48	-	-	-			
CAIXA FI BRASIL IRF M1 TP RF - TCE	R\$ 72.867.263,59	R\$ 73.160.490,47	0,6068	0,3144	0,4024	1,3292%	6,5520%	6,5520%
BB PREV. RF IRF M1 - TCE	R\$ 71.140.900,39	R\$ 71.423.609,39	0,5987	0,3068	0,3973	1,3083%	6,4922%	6,4922%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 730.809,42	R\$ 7.771,82						
TOTAL	R\$ 152.538.769,82	R\$ 145.264.003,16						

Quadro 39.

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

11.4 Composição dos Saldos - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	out/19	nov/19	dez/19
SALDO ANTERIOR	155.668.630,53	153.839.732,97	152.538.769,82
CONTRIB. PREVIDENCIÁRIA	1.738.581,72	2.670.383,28	1.281.462,77
VARIAÇÃO FINANCEIRA	915.133,66	464.465,88	1.518.013,09
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(4.482.612,94)	(4.435.812,31)	(10.082.013,34)
SALDO FINAL	R\$ 153.839.732,97	R\$ 152.538.769,82	R\$ 145.256.232,34

Quadro 40.

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

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

12. ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS

12.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2019		LIMITE DA RESOLUÇÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR		
TÍTULOS DO TN	RS 639.390.098,64	10,79%	11%	100%	100%	art. 7º, inciso I, "a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	RS 253.409.299,60	46,04%	50%	100%	100%	art. 7º, inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	RS 19.830.095,05					
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	RS 13.024.126,05					
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	RS 860.946.386,26					
SANTANDER FIC IMA B-5	RS 182.327.839,97					
SANTANDER FIC IMA B INST. TP RF LP	RS 23.898.291,44					
CAIXA FI BRASIL IRF M I TP RF	RS 259.220.007,19					
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	RS 786.165.139,76					
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	RS -					
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	RS 44.884.920,74					
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	RS 52.723.442,05					
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	RS 54.105.864,09					
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	RS 111.187.148,23					
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	RS 65.173.881,43					
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO	RS 31.559.251,49	24,84%	40%	40%	40%	art. 7º, inciso IV, "a"
BRADERCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	RS 227.716.252,88					
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	RS 109.460.096,91					
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	RS 116.057.556,97					
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	RS 291.404.341,23					
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	RS 238.647.531,18					
SANTANDER RF ATIVO FIC FI	RS 16.944.002,80					
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	RS 439.271.854,78					
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	RS 13.007.150,82					
TÍTULOS CVS	RS 12.189.812,24					
TOTAL RENDA FIXA	RS 4.862.544.391,80	82,09%				

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2019		LIMITE DA RESOLUÇÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR		
BRADERCO INST IBR X ALPHA	RS 33.172.203,65	1,01%	8%	15%	30%	art. 8º, inciso I, "a"
ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI	RS 26.693.759,15					
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	RS 69.231.592,11	16,47%	8%	15%	20%	art. 8º, inciso II, "a"
BRADERCO FIA MID SMALL CAPS	RS 55.151.980,82					
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	RS 53.488.335,31					
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	RS 5.388.337,85					
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	RS 162.109.478,81					
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	RS 181.100.233,57					
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	RS 271.111.845,70					
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	RS 67.233.626,38					
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	RS 33.754.891,18					
SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES	RS 77.237.719,42					
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	RS 19.241.920,34	0,42%	3%	10%	10%	art. 8º, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO	RS -					
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	RS 5.641.186,09					
TOTAL RENDA VARIÁVEL	RS 1.060.557.110,38	17,91%				

TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	RS 5.923.101.502,18	100,00%
-----------------------------------	----------------------------	----------------

Quadro 41.

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% CARTEIRA	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 253.409.299,60	4,23%	20%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 19.830.095,05	0,33%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 13.024.126,05	0,22%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 860.946.386,26	14,39%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 291.404.341,23	4,87%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 53.488.335,31	0,89%	
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 182.327.839,97	3,05%	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 259.220.007,19	4,33%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 786.165.139,76	13,14%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ -	0,00%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 44.884.920,74	0,75%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 52.723.442,05	0,88%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 31.559.251,49	0,53%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 227.716.252,88	3,81%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 109.460.096,91	1,83%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 116.057.556,97	1,94%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 33.172.203,65	0,55%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 55.151.980,82		
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 238.647.531,18	3,99%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 439.271.854,78	7,34%	
SANTANDER IMA B INST. TP RF LP	R\$ 23.898.291,44	0,40%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 69.231.592,11	1,16%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 181.100.233,57	3,03%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 5.388.337,85	0,09%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 162.109.478,81	2,71%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 271.111.845,70	4,53%	
ICATÚ VANG. FI RF INFAÇÃO CP LP	R\$ 13.007.150,82	0,22%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 54.105.864,09	0,90%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 111.187.148,23	1,86%	
ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI	R\$ 26.693.759,15	0,45%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 67.233.626,38	1,12%	
SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 77.237.719,42	1,29%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 33.754.891,18	0,56%	
SANTANDER RF ATIVO FIC FI	R\$ 16.944.002,80	0,28%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 19.241.920,34	0,32%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO	R\$ -	0,00%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 65.173.881,43	1,09%	
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.641.186,09	0,09%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO	R\$ 5.271.521.591,30		

Quadro 42.

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

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

12.3 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 RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 253.409.299,60	11.328.882/0001-35	7.033.827.032,81	3,60%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	R\$ 19.830.095,05	19.523.305/0001-06	690.737.803,27	2,87%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 13.024.126,05	13.327.340/0001-73	2.584.536.131,14	0,50%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 860.946.386,26	13.322.205/0001-35	7.688.780.054,14	11,20%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 291.404.341,23	25.078.994/0001-90	9.800.245.404,11	2,97%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 53.488.335,31	29.258.294/0001-38	759.876.805,11	7,04%	
BRADERCO FI RF IRFM 1 TP	R\$ -	11.484.558/0001-06	739.650.976,36	0,00%	
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 31.559.251,49	08.246.263/0001-97	236.654.276,91	13,34%	
BRADERCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 227.716.252,88	03.399.411/0001-90	4.945.222.995,17	4,60%	
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 109.460.096,91	20.216.216/0001/04	834.237.998,50	13,12%	
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 116.057.556,97	28.515.874/0001-09	1.115.373.957,19	10,41%	
BRADERCO INST IBR X ALPHA	R\$ 33.172.203,65	14.099.976/0001-78	213.661.103,13	15,53%	
BRADERCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 55.151.980,82	06.988.623/0001-09	1.902.428.000,02	2,90%	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 259.220.007,19	10.740.670/0001-06	10.910.469.036,62	2,38%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 786.165.139,76	11.060.913/0001-10	9.819.854.122,58	8,01%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ -	10.577.503/0001-88	2.752.338.613,28	0,00%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 44.884.920,74	22.791.028/0001-27	262.800.930,14	17,08%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 52.723.442,05	22.791.074/0001-26	215.163.330,31	24,50%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 439.271.854,78	23.215.097/0001-55	9.818.666.120,10	4,47%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 5.388.337,85	10.577.512/0001-79	728.075.712,70	0,74%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 238.647.531,18	21.838.150/0001-49	5.156.074.278,85	4,63%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 69.231.592,11	08.817.414/0001-10	940.010.951,13	7,36%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 162.109.478,81	23.731.629/0001-07	2.457.745.616,59	6,60%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 181.100.233,57	24.571.992/0001-75	4.621.308.299,25	3,92%	
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 182.327.839,97	13.455.117/0001-01	1.270.875.315,97	14,35%	
SANTANDER IMA B INST. TP RF LP	R\$ 23.898.291,44	14.504.578/0001-90	1.008.932.506,25	2,37%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 77.237.719,42	02.436.763/0001-05	777.293.295,00	9,94%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 33.754.891,18	01.699.688/0001-02	843.213.617,81	4,00%	
SANTANDER RF ATIVO FIC FI	R\$ 16.944.002,80	26.507.132/0001-06	687.082.646,86	2,47%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 271.111.845,70	08.279.304/0001-41	2.163.582.480,78	12,53%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 54.105.864,09	10.922.432/0001-03	665.777.409,83	8,13%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 111.187.148,23	10.756.541/0001-06	1.315.613.511,92	8,45%	
ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI	R\$ 26.693.759,15	06.224.719/0001-92	179.074.946,94	14,91%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 65.173.881,43	30.659.168/0001-74	1.968.275.721,15	3,31%	
BTG ABSOLUTO INST. FI FIA	R\$ 67.233.626,38	11.977.794/0001-64	1.723.423.208,96	3,90%	
TOTAL	R\$ 5.233.631.334,05				

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14, § 1º	TOTAL APLICADO	CNPJ	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Resolução CMN nº 3.922/2010
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.641.186,09	14.386.860/0001-10	280.149.446,10	2,01%	5%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 19.241.920,34	21.595.829/0001-54	402.673.499,26	4,78%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO	R\$ -	19.436.818/0001-80	647.174.574,06	0,00%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 13.007.150,82	19.719.727/0001-51	554.579.402,01	2,35%	
TOTAL	R\$ 37.890.257,25				

TOTAL	R\$ 5.271.521.591,30
--------------	-----------------------------

Quadro 43.

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

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

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;

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

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

Nota 5: Registra-se o Desenquadramento ao Art. 14º da Resolução CMN nº. 3.922/10 referente a aplicação Bradesco Inst IBR X Alpha. De acordo com a instituição tratou-se de Desenquadramento passivo devido à resgates da aplicação ao final do mês de dezembro/2019, contudo, tal situação não deve gerar qualquer prejuízo à Amazonprev, pois nesse caso, prevalece o que está estabelecido no art. 21, Nota 3 acima.

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA NOV/19) EM R\$ MI	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (DEZEMBRO/2019)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB DTVM S.A	R\$ 1.078.436,17	R\$ 1.492.102.583,50	0,1384%	5%
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 760.368,70	R\$ 651.088.835,67	0,0856%	
BRADERSCO	R\$ 570.242,71	R\$ 573.117.342,72	0,1005%	
CAIXA	R\$ 371.644,36	R\$ 1.593.294.888,46	0,4287%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	R\$ 282.894,57	R\$ 334.162.744,81	0,1181%	
BANCO BTG	R\$ 111.984,66	R\$ 67.233.626,38	0,0600%	
BANCO SAFRA	R\$ 101.629,31	R\$ 84.415.801,77	0,0831%	
ICATÚ VANGUARDA DTVM S/A	R\$ 25.062,07	R\$ 476.105.767,99	1,8997%	

Quadro 44.

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

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

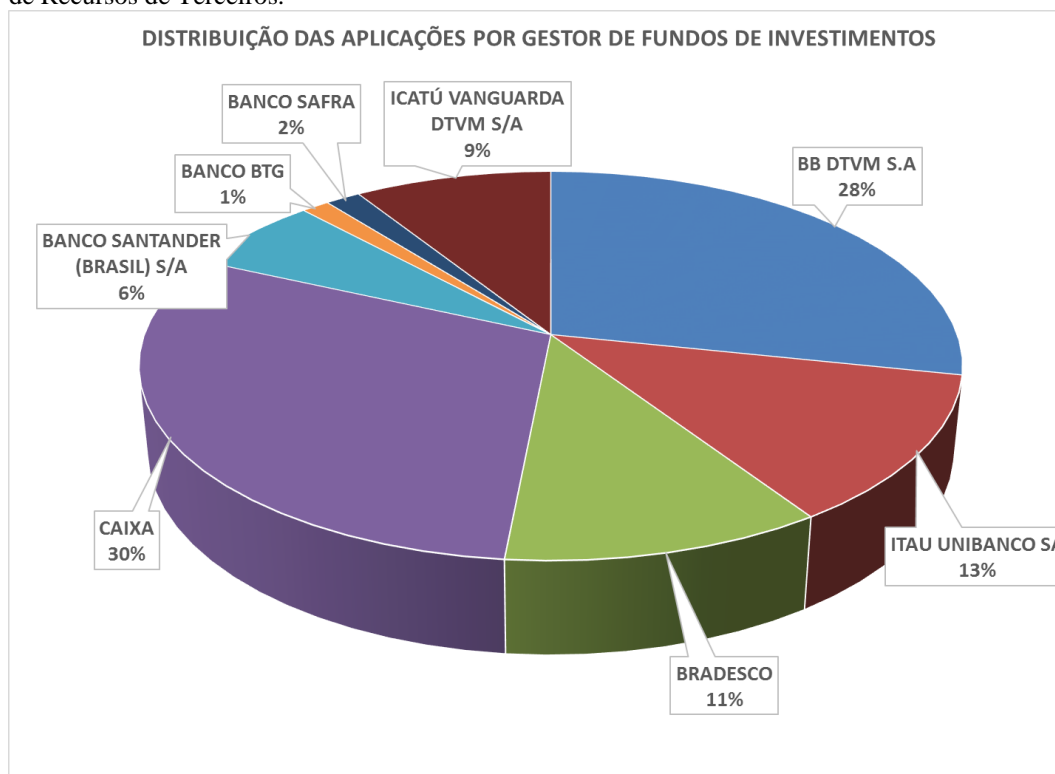


Gráfico 4.

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

13. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS AMAZONPREV

FPREV PODER EXECUTIVO	SALDO
FUNDO DE INVESTIMENTO FPREV - EXECUTIVO	R\$ 4.464.209.613,81
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 637.224.750,82
TÍTULOS PÚBLICOS - CVS	R\$ 12.189.812,24
IMÓVEIS	R\$ 60.353.005,55
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EXECUTIVO	R\$ -
TOTAL	R\$ 5.173.977.182,42

ASSEMBLEIA LEGISLATIVA	SALDO
ALE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 10.225.727,27
ALE FPREV TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.165.347,82
ALE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
ALE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 208.719,44
ALE FFIN DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - ALE COBERTURA	R\$ -
TOTAL	R\$ 12.599.795,53

PROCURADORIA GERAL DE JUSTIÇA - PGJ/MPE	SALDO
MPE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 142.453.819,79
MPE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 3.118,26
MPE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 388.158,17
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - PGJ/MPE - FFIN	R\$ 1,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - MPE COBERTURA	R\$ -
TOTAL	R\$ 142.845.097,22

DEFENSORIA PÚBLICA - DPE/AM	SALDO
DPE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 12.456.409,14
DPE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
DPE - FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 456.851,77
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - DPE - FFIN	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - DPE COBERTURA	R\$ -
TOTAL	R\$ 12.913.260,91

TRIBUNAL DE JUSTIÇA - TJ/AM	SALDO
TJ/AM FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 387.059.194,52
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA	R\$ 1,00
TJ/AM - FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 22.151.234,44
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA - FPREV	R\$ -
TOTAL	R\$ 409.210.429,96

TRIBUNAL DE CONTAS DO ESTADO - TCE/AM	SALDO
TCE/AM FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 145.256.231,34
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TCE	R\$ 1,00
TCE/AM - FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 3.506.553,79
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TCE/FPREV	R\$ 7.771,82
TOTAL	R\$ 148.770.557,95

OUTROS RECURSOS	SALDO
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO EXECUTIVO	R\$ 41.124.532,92
DISP. FINANCEIRA - TAXA DE ADM. EXECUTIVO	R\$ 1,00
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - ALE	R\$ 799.940,92
DISP. FINANCEIRA - TX DE ADM. ALE	R\$ -
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO TCE	R\$ 328.741,68
DISP. FINAN CEIRA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO TCE	R\$ -
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO TJA	R\$ 1.087.176,96
DISP. FINAN CEIRA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO TJA	R\$ -
FUNDO FINANCEIRO - EXECUTIVO	R\$ 35.867.132,38
FUNDO FINANCEIRO - COMPREV	R\$ 3.941.552,96
DISP. FINANCEIRA - FFIN EXECUTIVO	R\$ -
DISP. FINANCEIRA - FFIN EXECUTIVO - COBERT. DEFICIT	R\$ 34.976,25
DISP. FINANCEIRA - SAL. NÃO RECLAMADOS	R\$ 191.308,78
DISP. REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ -
TOTAL	R\$ 83.375.363,85
TOTAL GERAL	R\$ 5.983.691.687,84

Quadro 45.

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

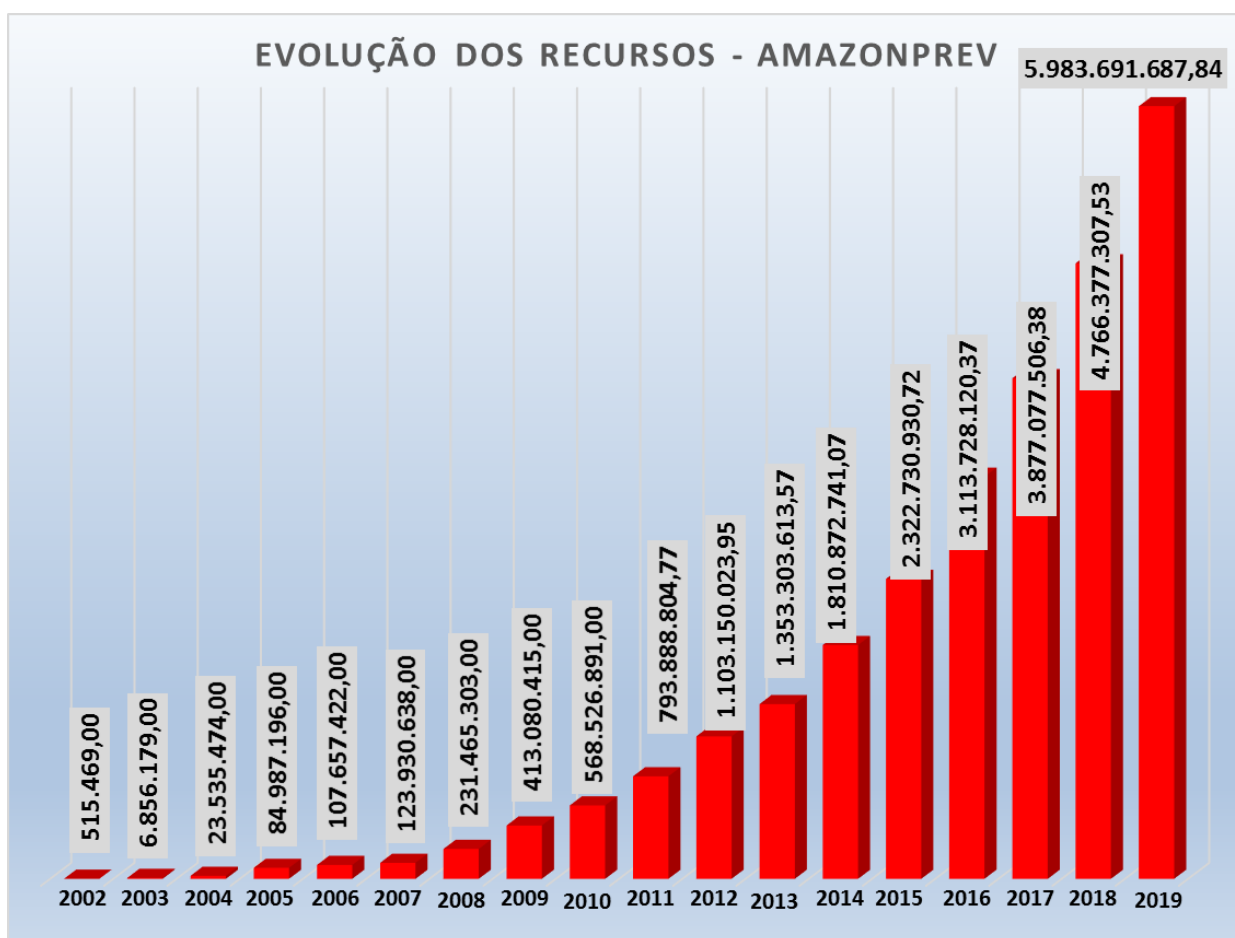


Gráfico 5.

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

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

15. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV EXECUTIVO:	a) Novos Recursos: Serão aplicados no fundo Bradesco FIA MID Small Caps.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2020
	b) Fundos de Curto Prazo: Manter, regularmente, saldo de aplicação no fundo Bradesco Maxi Poder Público no valor de R\$ 2.000.000,00 (dois milhões de reais), já que possui baixa automática otimizando o processo de pagamentos de rotina, incluindo folha de pagamento de aposentados e pensionistas do FPREV.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2020
FPREV ALE:	Novos Recursos: Novas aplicações devem ser aplicados: em 25% BTG Patual Absoluto, 25% Icatu Dividendos 30, 20% Occam FIA e 30% Icatu CP.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2020
FPREV MPE/PGJ:	Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Alocação Dinâmica, visando obter resultados acima do CDI no Longo prazo.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2020
	Recursos Atuais: Zerar posição no fundo BB Previdenciário IMA B5+, direcionando para o fundo BB Ações Valor. Zerar posição no fundo BB Previdenciário IDKA 2, direcionando para o fundo BB Previdenciário Alocação Dinâmica	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2020
FPREV - DPE/AM	Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Alocação Dinâmica, visando obter resultados acima do CDI no Longo prazo.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2020
FPREV - TJ/AM	Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Institucional FIC FI RF IMA-B 5, em linha com os dados apresentados no Cenário e buscando resultados acima do índice no longo prazo, e cumprindo os termos da Política de Investimentos da Amazonprev.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2020
FPREV - TCE/AM:	Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Institucional FIC FI RF IMA-B 5, em linha com os dados apresentados no Cenário de curto prazo, buscando resultados acima do índice no longo prazo, e cumprindo os termos da Política de Investimentos da Amazonprev.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2020
Outros Repasses – TCE e TJAM:	a) Novos recursos: os novos recursos recebidos pelo TCE e TJAM, devem ser direcionados para o fundo Bradesco Maxi Poder Público.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2020
	b) Demais Recursos: Migrar R\$ 100 milhões aplicados nos fundos BB Previdenciário IRF M1 e Caixa FI Brasil IRF M1 para os fundos BB Previdenciário Alocação e FI Caixa Gestão Estratégica.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2020
FFIN - EXECUTIVO, ALE, DPE e MPE:	Aplicar os recursos no fundo Bradesco Maxi Poder Público, facilitando a operacionalização dos pagamentos das folhas de inativos e pensionistas desses órgãos. Devem ser observados os limites para aplicação conforme legislação vigente.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2020
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	15/02/2020
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 GERAF/COFIN pode solicitar transferência de valores da Caixa para o Bradesco.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2020
Atividades Externas	Realização de Visitas técnicas às instituições financeiras: BTG Pactual e Icatu Vanguarda, para elaboração de relatórios de verificação dos lastros relativos aos títulos ou a papéis incluídos em operações estruturadas adquiridas por meio de veículos de investimento, e de acompanhamento sistemático da situação patrimonial, fiscal, comercial e jurídica das instituições investidas e do desempenho dos papéis por elas emitidos	COMIV	03 a 05 de fevereiro/2020

Quadro 46.

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

16. RELATÓRIO DE RISCO DOS ATIVOS

16.1 ACOMPANHAMENTO DOS RISCOS POR FUNDO DE INVESTIMENTOS

FUNDOS DE INVESTIMENTOS	VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE	DRAWDOWN	
	MÊS %	12 M %	MÊS %	12 M %	12 M %	MÊS %	12 M %
BB PREV RF IDKA 2	1,31%	1,46%	2,15%	2,44%	3,60711	-0,23%	-0,49%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	6,37%	7,07%	10,29%	11,72%	3,24231	-4,74%	-4,74%
BB PREVID RF IRFM 1 TP	0,14%	0,26%	0,25%	0,45%	2,19579	0,00%	-0,03%
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC DE FI	2,49%	2,37%	4,13%	3,94%	3,00718	-1,18%	-1,22%
BB PREVID TIT PUB VII FI	1,06%	1,26%	1,79%	2,10%	3,59630	-0,13%	-0,52%
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	8,31%	17,11%	14,07%	28,29%	1,99335	-0,82%	-8,96%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	2,24%	2,21%	3,73%	3,68%	2,93120	-1,16%	-1,20%
BRANCO FIA MID SMALL CAPS	9,84%	15,43%	16,66%	25,53%	2,40817	-0,75%	-7,05%
BRANCO FI REFER DI PREMIUM	0,02%	0,05%	0,06%	0,00%	-2,04832	0,00%	0,00%
BRANCO FIC FIA INSTITUCIONAL	9,06%	17,11%	15,25%	28,26%	1,62006	-1,06%	-8,04%
BRANCO INST. FIC FI RF IMA B5	2,13%	2,07%	3,56%	3,46%	3,36289	-0,69%	-0,81%
BRANCO MAXI PD PÚBLICO	0,01%	0,03%	0,03%	0,07%	-7,71875	0,00%	0,00%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	8,39%	16,58%	14,13%	27,41%	1,99934	-1,05%	-7,45%
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	0,89%	3,86%	1,50%	6,37%	-0,77131	-0,29%	-2,72%
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	3,64%	5,03%	6,06%	8,31%	1,15512	-1,29%	-3,54%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF	2,09%	1,98%	3,49%	3,30%	3,48435	-0,63%	-0,71%
CAIXA FI BRASIL IRFM 1	0,14%	0,25%	0,25%	0,43%	2,51761	0,00%	-0,03%
CAIXA FIA CONSUMO	12,88%	17,43%	21,57%	28,85%	2,82547	-1,39%	-10,18%
CAIXA GESTÃO ESTRATEGICA	1,60%	3,73%	2,61%	6,20%	3,01715	-0,81%	-2,73%
FIC CAIXA CAPITAL PROTEGIDO	10,86%	3,68%	17,64%	6,07%	-0,30082	-4,81%	-4,81%
ICATU DIVIDENDOS FIA	6,90%	14,55%	11,70%	24,08%	2,50880	-0,66%	-6,99%
ICATU INFLAÇÃO CRÉDITO PRIVADO	2,28%	1,94%	3,80%	3,24%	3,15948	-1,13%	-1,13%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA	2,15%	2,02%	3,59%	3,37%	3,44857	-0,67%	-0,74%
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA	8,80%	7,38%	14,60%	12,25%	3,23675	-4,89%	-4,89%
ICATU VANGUARDA AÇÕES IBx FI	9,48%	17,45%	15,92%	28,82%	1,65410	-1,23%	-9,44%
ITAU AÇÕES PHOENIX FIC FI	9,08%	17,39%	15,40%	28,75%	1,94059	-0,42%	-9,05%
ITAU DUNAMIS FIC	8,38%	16,31%	14,15%	26,98%	2,40098	-0,98%	-9,59%
ITAU FOF RPI AÇÕES	8,25%	16,22%	13,95%	26,80%	1,78668	-0,85%	-9,09%
ITAU INSTIT ALOC DINÂMICA RF FIC	0,02%	2,01%	0,04%	3,35%	2,96591	0,00%	-1,15%
SAFRA IMA INST. FI FIC RF	6,41%	5,53%	10,65%	9,19%	3,21148	-3,09%	-3,33%
SAFRA S&P REAIS PB MM	7,02%	12,68%	11,67%	20,96%	2,04670	-1,82%	-15,24%
SANTANDER AÇÕES TOP SELEÇÃO	9,05%	16,96%	15,24%	28,02%	1,58395	-1,01%	-7,65%
SANTANDER ATIVO RENDA FIXA	0,23%	2,49%	0,39%	4,15%	2,61539	-0,01%	-1,64%
SANTANDER FIC FI IMA B	5,70%	4,92%	9,47%	8,18%	3,36797	-2,97%	-2,97%
SANTANDER FIC IMA-B 5 TIT PUB RF	2,05%	1,97%	3,44%	3,30%	3,51582	-0,59%	-0,71%
SANTANDER IBOVESPA AÇÕES	9,11%	17,18%	15,34%	28,38%	1,55910	-1,00%	-8,80%

RISCOS DA CARTEIRA AMAZONPREV

CARTEIRA AMAZONPREV	2,16%	2,54%	3,66%	4,23%	3,43805	-0,23%	-1,12%
---------------------	-------	-------	-------	-------	---------	--------	--------

Quadro 47.

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

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

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

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

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

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

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

16.2 DETALHAMENTO POR FUNDO DE INVESTIMENTOS

FUNDOS DE INVESTIMENTOS	GESTOR	ENQUADRAMENTO	BENCHMARK	SALDO	PRAZO DE DURAÇÃO DO ATIVO	PRAZO DE RESGATE	CONCEITO DA VOLATILIDADE REPRESENTADA (RISCO)	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO
BB PREVID RF IDKA 2	BB DTVM	ART. 7º, I, "b"	IDKA IPCA 2A	860.946.386,26	INDETERMINADO	D+1	MUITO BAIXO	1,000%
BB PREVID RF IRFM 1 TP	BB DTVM	ART. 7º, I, "b"	IRF-IMI	253.409.299,60	INDETERMINADO	D+1	MUITO BAIXO	2,500%
BRADESCO FI REFER DI PREMIUM	BRAM - DTVM	ART. 7º, IV, "a"	CDI	227.716.252,89	INDETERMINADO	D+0	MUITO BAIXO	0,200%
BRADESCO FI RF MAXI PODER PUB	BRAM - DTVM	ART. 7º, IV, "a"	CDI	31.559.251,54	INDETERMINADO	D+0	MUITO BAIXO	0,200%
NTN-B	TESOURO NACIONAL	ART. 7º, I, "a"	IPCA + 6,48% a.a	152.495.743,65	15/05/2023	D+1	MUITO BAIXO	0,000%
NTN-B	TESOURO NACIONAL	ART. 7º, I, "a"	IPCA + 6,59% a.a	160.734.967,30	15/08/2030	D+1	MUITO BAIXO	0,000%
NTN-B	TESOURO NACIONAL	ART. 7º, I, "a"	IPCA + 6,90% a.a	161.880.612,44	15/08/2030	D+1	MUITO BAIXO	0,000%
NTN-B	TESOURO NACIONAL	ART. 7º, I, "a"	IPCA + 6,60% a.a	164.274.775,25	15/08/2040	D+1	MUITO BAIXO	0,000%
CVS - A	TESOURO NACIONAL	Em enquadramento	0,50% a.m	1.466.892,62	01/01/2027	-	MUITO BAIXO	0,000%
CVS - B	TESOURO NACIONAL	Em enquadramento	3,12% a.a	9.491.736,10	01/01/2027	-	MUITO BAIXO	0,000%
CVS - C	TESOURO NACIONAL	Em enquadramento	0,50% a.m	190.288,28	01/01/2027	-	MUITO BAIXO	0,000%
CVS - D	TESOURO NACIONAL	Em enquadramento	3,12% a.a	1.040.895,24	01/01/2027	-	MUITO BAIXO	0,000%
				2.025.211.101,17				0,000%
BB PREVID TIT PUB VII FI	BB DTVM	ART. 7º, I, "b"	IMA-B	19.830.095,05	INDETERMINADO	D+1	BAIXO	0,200%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA	ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7º, I, "b"	IMA-B 5	54.105.864,09	INDETERMINADO	D+1	BAIXO	0,400%
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	ART. 7º, I, "b"	IRF-IMI	259.220.007,21	INDETERMINADO	D+0	BAIXO	0,200%
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	BRAM - DTVM	ART. 7º, IV, "a"	IPCA	116.057.556,97	INDETERMINADO	D+4	BAIXO	0,400%
SAFRA S&P REAIS PB IMM	SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA	ART. 8º, III	CDI	19.241.920,34	INDETERMINADO	D+2	BAIXO	0,200%
				468.455.443,66				
BRADESCO FIC RF IMA B5	BRAM - DTVM	ART. 7º, IV, "a"	IMA-B 5	109.460.096,91	INDETERMINADO	D+1	MÉDIO	0,200%
CAIXA BR GESTÃO ESTRATÉGICA	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7º, IV, "a"	IPCA	439.271.854,78	INDETERMINADO	D+0	MÉDIO	1,600%
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7º, I, "a"	IMA-B	44.884.920,75	16/08/2020	-	MÉDIO	1,600%
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7º, I, "b"	IMA-B	52.723.442,05	16/08/2024	-	MÉDIO	2,000%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL RF LP	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.	ART. 7º, I, "b"	IMA-B	23.898.291,44	INDETERMINADO	D+4	MÉDIO	0,200%
SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7º, I, "b"	IPCA	16.944.002,80	INDETERMINADO	D+1	MÉDIO	0,400%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7º, I, "b"	IMA-B 5	786.165.139,76	INDETERMINADO	D+0	MÉDIO	0,400%
SANTANDER FIC IMA-B 5 TP RF	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7º, I, "b"	IMA-B 5	182.327.839,98	INDETERMINADO	D+1	MÉDIO	0,250%
				1.655.675.588,47				

Quadro 48.

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

FUNDOS DE INVESTIMENTOS	GESTOR	ENQUADRAMENTO	BENCHMARK	SALDO	PRAZO DE DURAÇÃO DO ATIVO	PRAZO DE RESGATE	CONCEITO DA VOLATILIDADE REPRESENTADA (RISCO)	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO
BTG ABSOLUTO FII FIA	BTG Pactual Asset Management S.A. - DTVM	ART. 8º, II, "a"	IBOVESPA	67.233.626,38	INDETERMINADO	D+33	ALTO	3,000%
CAIXA FIA CONSUMO	CAIXA ECONÔMICA	ART. 8º, II, "a"	ICON	5.388.337,85	INDETERMINADO	D+3	ALTO	0,10% a 0,30%
FII CAIXA CAPITAL PROTEGIDO	CAIXA ECONÔMICA	ART. 8º, III	IBOVESPA	5.641.186,09	31/12/2019	-	ALTO	0,200%
ICATU DIVIDENDOS FIA	ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8º, II, "a"	IBOVESPA	271.111.845,70	INDETERMINADO	D+4	ALTO	0,200%
ICATU INFLAÇÃO CRÉDITO PRIVADO	ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7º, VII, "a"	IMA-B 5	13.007.150,82	INDETERMINADO	D+21	ALTO	0,200%
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES MID SMALL CAPS	BRAM - DTVM	ART. 8º, II, "a"	IBRX	55.151.980,82	INDETERMINADO	D+3	ALTO	1,500%
BB AÇÕES VALOR FII FII EM AÇÕES	BB DTVM	ART. 8º, II, "a"	-	53.488.335,31	INDETERMINADO	D+32	ALTO	2,000%
BRADESCO FII AÇÕES INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	BRAM - DTVM	ART. 8º, I, "a"	IBOVESPA	33.172.203,65	INDETERMINADO	D+2	ALTO	0,900%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FII FII RENDA FIXA	BANCO J. SAFRA S/A	ART. 7º, I, "b"	IMA-B	65.173.881,43	INDETERMINADO	D+4	ALTO	0,200%
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA	ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7º, I, "b"	IMA-B 5+	111.187.148,23	INDETERMINADO	D+1	ALTO	0,200%
ICATU VANG. IBX FII AÇÕES	ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8º, I, "a"	IBOVESPA	26.693.759,15	INDETERMINADO	D+4	ALTO	0,35% A 0,40%
ITAU INSTTT ALOC DINÂMICA I	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 7º, IV, "a"	IPCA	238.647.531,18	INDETERMINADO	D+1	ALTO	0,200%
BB PREVID TIT PUB IMA B5+	BB DTVM	ART. 7º, I, "b"	IMA-B 5+	13.024.126,05	INDETERMINADO	D+1	MUITO ALTO	2,500%
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FII DE FII	BB DTVM	ART. 7º, I, "b"	IMA-B	291.404.341,24	INDETERMINADO	D+3	MUITO ALTO	0,300%
SANTANDER IBOVESPA INSTITUCIONAL AÇÕES	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8º, II, "a"	IBOVESPA	33.754.891,18	INDETERMINADO	D+3	MUITO ALTO	0,750%
ITAU AÇÕES PHOENIX FII FII	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 8º, II, "a"	IBOVESPA	162.109.478,81	INDETERMINADO	D+24	MUITO ALTO	1,900%
ITAU DUNAMIS FII FIA	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 8º, II, "a"	IBOVESPA	181.100.233,57	INDETERMINADO	D+24	MUITO ALTO	1,500%
ITAU FOF RPI AÇÕES	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 8º, II, "a"	IBOVESPA	69.231.592,08	INDETERMINADO	D+5	MUITO ALTO	0,400%
SANTANDER AÇÕES TOP SELEÇÃO	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8º, II, "a"	IBOVESPA	77.237.719,42	INDETERMINADO	D+4	MUITO ALTO	0,500%
			TOTAL	827.862.382,34				
				5.923.101.502,25				

Quadro 48-A

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

VOLATILIDADE DA CARTEIRA COM BASE NA NOTA DE RISCO DO ADMINISTRADOR

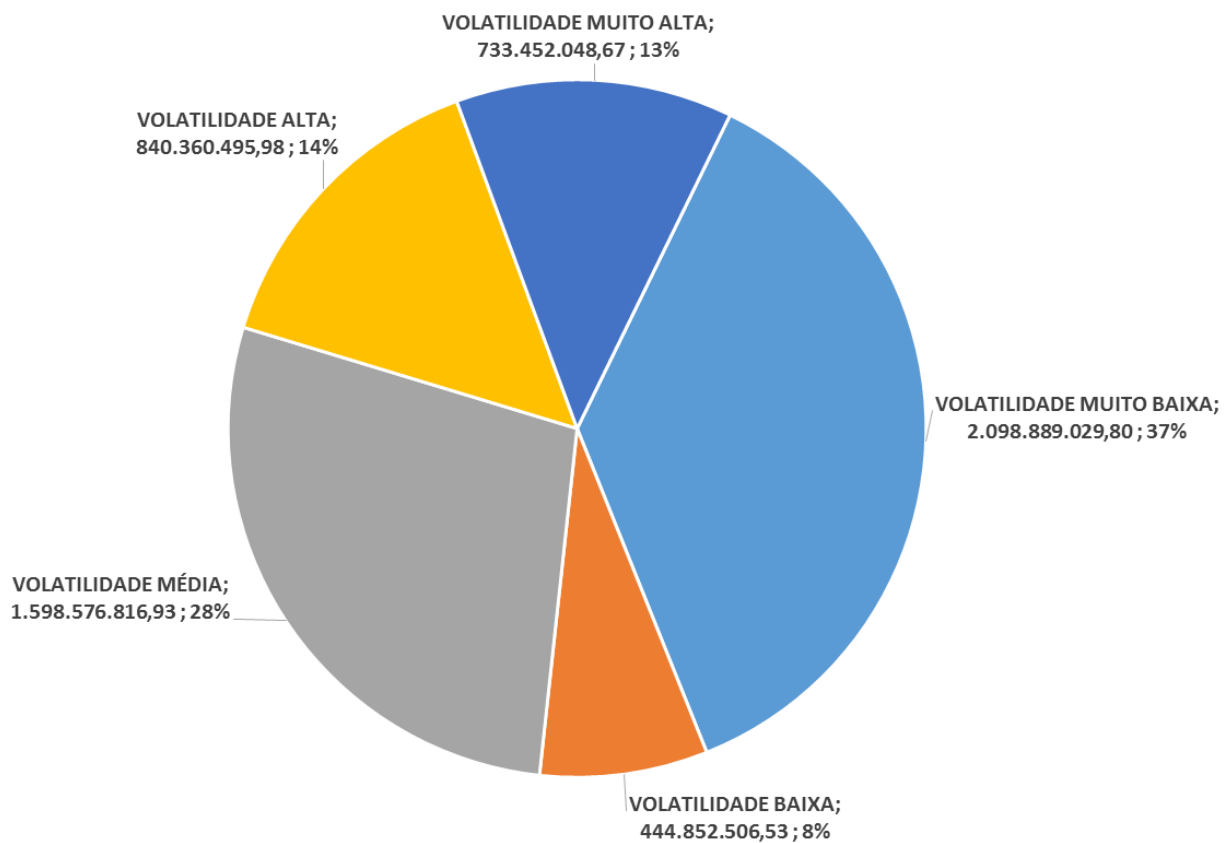


Gráfico 6.

Relatório de Anual de Investimentos - 2019

17. VERIFICAÇÃO DE LASTRO DOS FUNDOS DE RISCO DE CRÉDITO

TABELA - DURATION & YIELD POR CLASSE			
Ativo	Duration	Spread	% PL
DEB	3,48	1,14%	61,1%
CRU	0,00	0,00%	0,0%
LF	2,58	0,39%	11,3%
COB	1,09	0,48%	1,0%
DPGE	0,00	0,00%	0,0%
NP	2,48	0,53%	0,7%
FDC	0,00	0,00%	0,0%
NTN-B	3,46	-	22,0%
Over	0,00	-	2,7%
Carteira Crédito	3,39	1,01%	74,7%
Crédito - Contribuição Fundo	0,79	0,75%	74,7%
Fundo (Inclui DAP e NTN-B)	2,79	0,75%	300,0%

TABELA - RATING EXTERNO*		
Rating	Financiaria	% PL
AAA	119.741.811	21,0%
AA+	83.696.001	15,1%
AA	103.676.956	18,7%
AA-	28.705.965	5,3%
A+	18.494.263	3,3%
DPGE	0	0,0%
A	11.860.068	2,1%
A-	10.836.927	2,0%
BBB+	14.994.229	2,7%
BBB	0	0,0%
BBB-	0	0,0%
BB+	18.508.579	3,3%
BB	0	0,0%
BB-	3.790.662	0,7%
B+	0	0,0%
B	0	0,0%
B-	0	0,0%
CCC	0	0,0%
CC	0	0,0%
C	0	0,0%
Sem Limite	0	0,0%
Tesouro / Over	140.333.645	25,3%
Total	554.636.700	100,0%

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

TABELA - SETOR		
Setor	Financiaria	% PL
Elétrico	125.050.824	22,7%
Bancos	71.580.926	12,9%
Saneamento	40.311.472	7,3%
Conc. Rodovias	39.736.658	7,2%
Serviço	30.630.157	5,5%
Óleo e Gás	17.010.550	3,1%
Varejo	16.727.507	3,0%
Mineração e Siderurgia	16.005.475	3,0%
Holding	15.688.697	2,8%
Shopping Center	14.752.972	2,7%
Consumo	14.738.236	2,7%
Infraestrutura	4.557.097	0,8%
Papel e Celulose	3.263.811	0,6%
Logística	2.963.675	0,5%
Tesouro / Over	140.333.645	25,3%
Total	554.636.700	100,0%

TABELA - EMISSOR		
Emissor	Financiaria	% PL
Eletrobras	20.104.898	3,6%
CEMIG D	18.508.579	3,3%
LOJAS AMERICANAS	16.727.507	3,0%
BIO PARANAPANEMA ENERGIA	15.568.290	2,8%
NATURA	14.738.236	2,7%
COFAGE	12.805.757	2,3%
Livri	12.659.171	2,3%
Ultramar	11.508.925	2,1%
SABSP	10.918.332	2,0%
Rota das Bandeiras	10.836.927	2,0%
Banco FIDIS	10.801.819	1,9%
AES TETE	10.497.263	1,9%
CCR AUTOSAN	10.109.831	1,8%
Smartfit	9.992.231	1,8%
PETROBRAS	9.653.439	1,7%
Bradesco	9.177.086	1,7%
SANEPAR	8.559.834	1,5%
Dasa	8.425.277	1,5%
Daycoval	8.258.799	1,5%
TAGSA	8.229.967	1,5%
Águas de Guaratuba	8.027.549	1,4%
COPEL	7.389.713	1,3%
COMGÁS	7.357.111	1,3%
MULTIPLAN	7.227.925	1,3%
LOCALIZA	7.138.471	1,3%
Sofisa	6.904.903	1,2%
Alfa	5.776.940	1,0%
ECOVIAS	5.567.375	1,0%
Safra	5.453.337	1,0%
Triângulo	5.320.805	1,0%
Eneva	5.290.751	1,0%
Itaú	5.271.618	1,0%
VALE	4.756.550	0,9%
Omega Geração	4.663.967	0,8%
TERMOFERNAMBUCO	4.628.896	0,8%
Gerdev	4.557.097	0,8%
CCP	4.417.631	0,8%
BRGE BITTENCOURT	4.404.922	0,8%
EQUATORIAL	3.800.962	0,7%
Concessionária Auto Raposo Tava	3.790.662	0,7%
Alupar	3.731.058	0,7%
BNB	3.607.204	0,7%
CPFL GERAÇÃO	3.471.689	0,6%
Volkswagen	3.349.516	0,6%
Suzano	3.262.811	0,6%
Caixa	3.226.612	0,6%
Unidas	3.200.992	0,6%
Eletropaulo	3.052.609	0,6%
Itaúsa	3.029.526	0,5%
MRS LOGÍSTICA	2.963.675	0,5%
ABC Brasil	2.932.595	0,5%
ECORODOVIAS	2.838.469	0,5%
Santo Antônio Energia	2.787.403	0,5%
ENEL BR	2.740.108	0,5%
ENEL CEARÁ	2.339.067	0,4%
ECOPEVAS	2.188.472	0,4%
Banrisul	2.111.628	0,4%
Movida	1.873.187	0,3%
EDP SAO PAULO	1.845.812	0,3%
Caixa	1.825.967	0,3%
BRMALLS	1.779.178	0,3%
EDP ESPÍRITO SANTO	1.435.620	0,3%
CPFL RGE	1.419.536	0,3%
IGUATEMI	1.014.101	0,2%
COELBA	808.001	0,1%
Votorantim	685.710	0,1%
SONAT SIERRA	344.137	0,1%
Tesouro / Over	140.333.645	25,3%
Total	554.636.700	100,0%

Quadro 49.

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



GOVERNO DO ESTADO DO AMAZONAS



AMAZONPREV

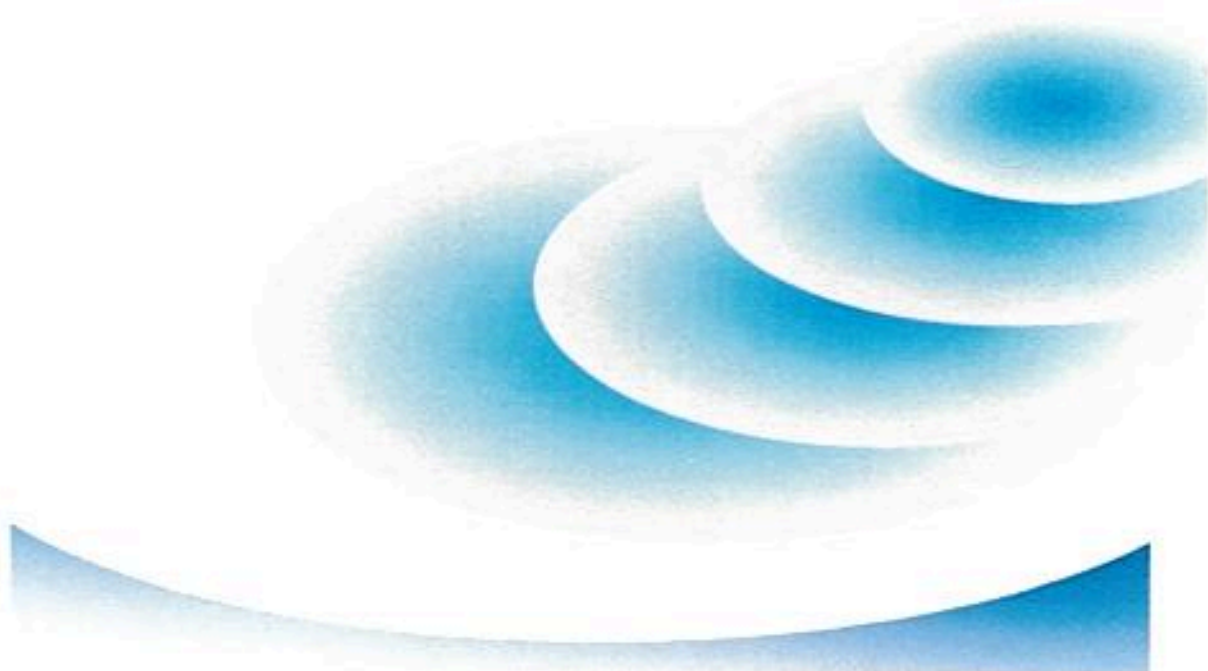
Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



RELATÓRIOS - 2020

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Dezembro / 2020



Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

Destino: DIRAF / PRESI

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

Data: 15/01/2021

RELATÓRIO N°. 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



Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

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

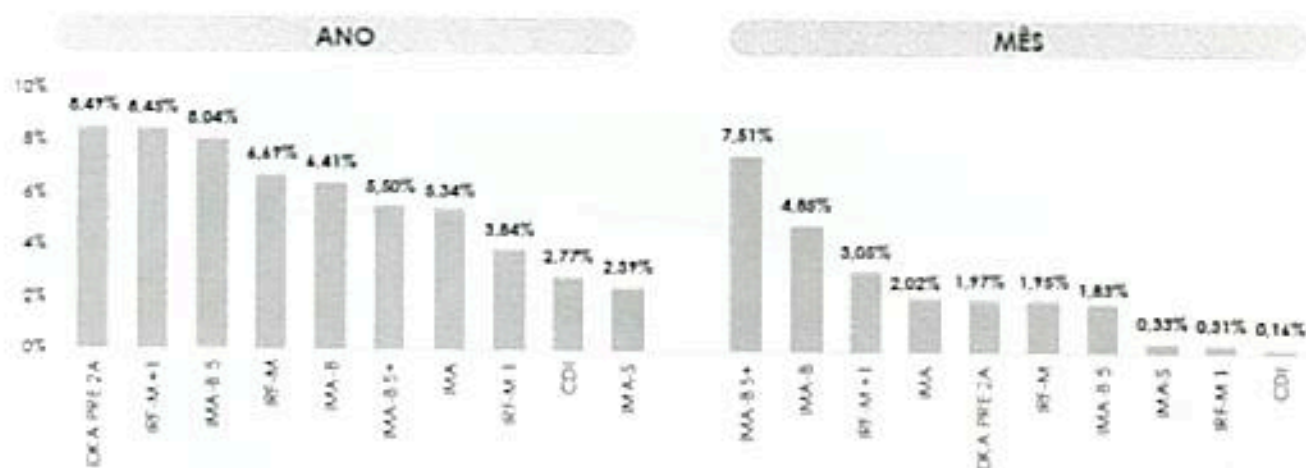


4

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

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

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	out20	nov20	dez20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 371.137.985,89	R\$ 379.987.948,55	(0,0702)	0,8479	2,3790	3,1746%	5,0890%	5,0890%
BB PREVID TP VII	R\$ 6.973.809,22	R\$ 7.037.946,27	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
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 22.942.174,73	R\$ -	(0,2800)	0,7800	-	0,4978%	2,1230%	2,1230%
BRADESCO MANI PODER PUBLICO	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	out20	nov20	dez20	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 NIVEL I	R\$ 69.920.316,21	R\$ 70.397.488,98	(1,7371)	2,1010	0,6824	1,0120%	18,2100%	NC
BRADESCO 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
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX 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 VANGUARDA 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 VANGUARDA 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 DYNAMIS 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%	-8,2311%	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
BRADERSCO	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

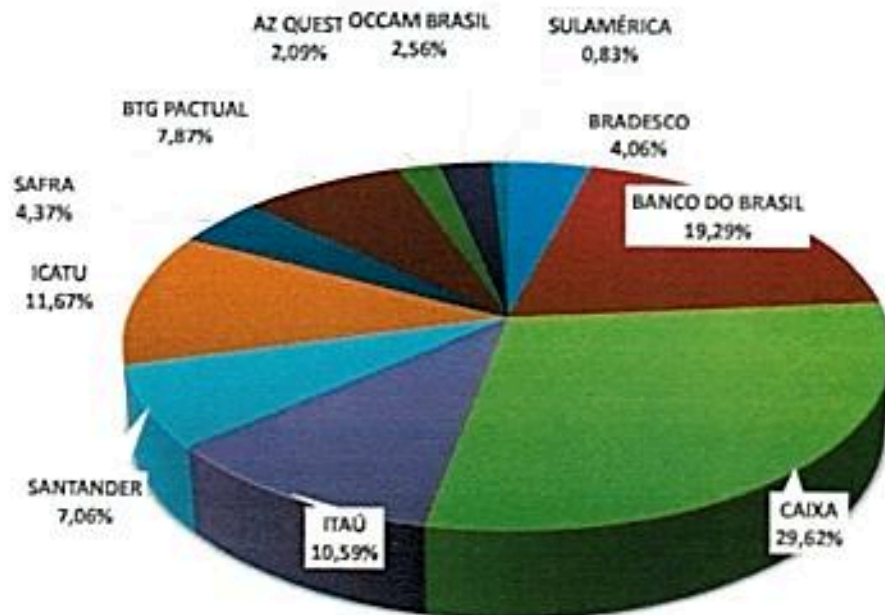


Gráfico 1

(Assinatura)

(Assinaturas)

2.3 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA – FPREV EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	ÍNDICE DE REFERÊNCIA	SALDO APLICADO	% APLICADO
BRDESCO FI MANI PODER PUBLICO	CDI	R\$ 2.002.164,94	0,05%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA BB PREVID ALOCAÇÃO ATIVA SAFRA S&P REALS BRADESCO 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 ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	IMA B 5	R\$ 631.131.012,77	15,54%
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF BTG ECONOMIA REAL FIP BB PREVID TP VII	IMA B5+	R\$ 94.808.812,56	2,33%
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA ICATU VANGUARDA AÇÕES IRIX FI	IBR X	R\$ 62.473.856,46	1,54%
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA BRADESCO FIA MID SMALL CAPS ITAÚ SMALL CAPS VALUATION CAIXA CONSUMO FI AÇÕES ICATU VANGUARDA 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 NIVEL I	BDR	R\$ 165.487.091,98	4,07%
SANTANDER 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

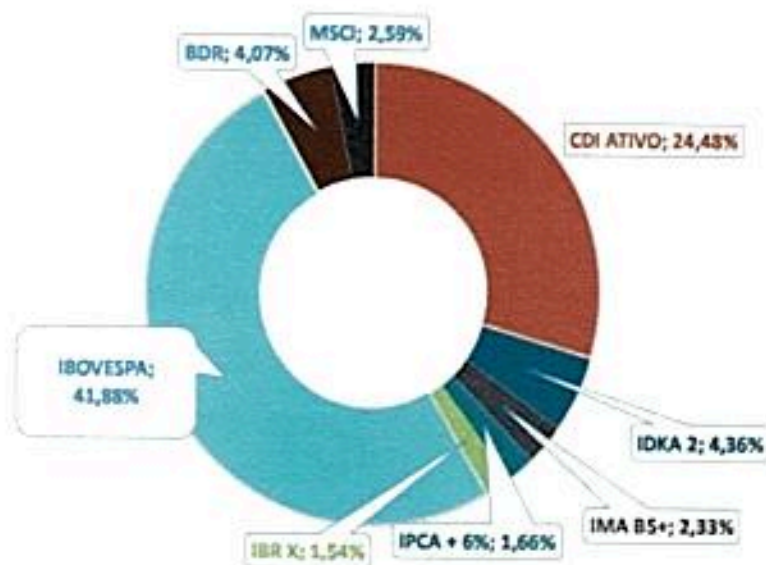


Gráfico 2.

(Assinaturas manuscritas)

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

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	Renda Fixa	Renda Fixa
TIPO DE ATIVO	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B
INTERMEDIÁRIO	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO
PREÇO UNITÁRIO DE COMPRA	R\$ 2.314,742871	R\$ 2.288,539269	R\$ 2.235,637189	R\$ 2.254,343911
QUANTIDADE	43.100	43.450	44.113	44.350
APLICAÇÃO INICIAL	R\$ 99.765.417,74	R\$ 99.437.031,23	R\$ 98.620.663,31	R\$ 99.980.152,45
VALOR ATUAL	R\$ 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.

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

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.

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

2.11 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS – FPREV EXECUTIVO

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Annual	12 Meses
dez/19	RS 5.173.977.182,42	4,14%	27,68%	27,68%
jan/20	RS 5.215.753.953,85	0,81%	0,81%	25,83%
fev/20	RS 5.147.828.344,11	-1,30%	-0,51%	22,61%
mar/20	RS 4.677.866.125,22	-9,13%	-9,59%	9,54%
abr/20	RS 4.755.324.126,81	1,66%	-8,09%	9,55%
mai/20	RS 4.808.084.982,84	1,11%	-7,07%	8,26%
jun/20	RS 4.837.475.067,57	0,61%	-6,50%	6,07%
jul/20	RS 4.902.116.484,95	1,34%	-5,25%	5,41%
ago/20	RS 4.797.635.488,57	-2,13%	-7,27%	2,10%
set/20	RS 4.651.365.387,53	-3,05%	-10,10%	-3,39%
out/20	RS 4.549.328.612,79	-2,19%	-12,07%	-7,68%
nov/20	RS 4.700.643.285,36	3,33%	-9,15%	-5,39%
dez/20	RS 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	
Mês/Ano	Receitas RS	Despesas RS	Resultado RS
		Saldo Financeiro em 31/12/2019	5.173.977.182,42
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 RS	205.313.515,35	205.313.515,35	155.464.545,81
Resultado %	-5,9433%	-5,9433%	+1,4471%
Resultado RS	-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.




Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

2.13 ACOMPANHAMENTO DE SALDO DO FTEMP

ACOMPANHAMENTO DO SALDO DO FUNDO TEMPORÁRIO - FTEMP						
REFERÊNCIA	APOSENTADO	1ª PARC.13ª SALÁRIO APOSENTADO	PENSIONISTA	1ª PARC.13ª 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 204 de 16 de abril de 2020

Quadro 12.

Nota: Tabela atualizada com base nos Controles da GERAFF/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	set20	out20	nov20	dez20	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	set20	out20	nov20	dez20	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	set20	out20	nov20	dez20	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.

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

3.4 Evolução dos Recursos – ALE/FPREV

Mês	Recursos ALE FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
dez/19	RS 12.391.075,09	1,98%	28,40%	28,40%
jan/20	RS 12.693.470,60	2,44%	2,44%	26,47%
fev/20	RS 12.745.197,26	0,41%	2,86%	24,93%
mar/20	RS 12.694.389,88	-0,40%	2,45%	22,39%
abr/20	RS 12.933.067,87	1,88%	4,37%	15,66%
mai/20	RS 13.078.781,12	1,13%	5,55%	19,91%
jun/20	RS 13.459.597,92	2,91%	8,62%	20,10%
jul/20	RS 13.732.461,93	2,03%	10,83%	20,74%
ago/20	RS 13.805.725,52	0,53%	11,42%	20,51%
set/20	RS 13.772.193,11	-0,24%	11,15%	16,97%
out/20	RS 13.874.434,26	0,74%	11,97%	15,45%
nov/20	RS 14.548.050,57	4,86%	17,41%	19,73%
dez/20	RS 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	Receitas RS	Despesas RS	Resultado RS
	Saldo Financeiro em 31/12/2019		12.391.075,09
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 31/12/2020		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 RS	1.090.136,08	1.090.136,08	485.508,31
Resultado %	-2,1530%	-2,1530%	+1,4765%
Resultado RS	-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	out20	nov20	dez20	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
BRANCO 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	out20	nov20	dez20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRANCO FIC FIA INSTIT IIBRX 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\$
			Saldo Financeiro em 31/12/2019 142.456.938,05
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 31/12/2020 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

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

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	set/20	out/20	nov/20	dez/20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	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

Ciente: Govetto Amazonas / AM - DEFENSORIA2020

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 30/11/2019		9.856.121,02
	Saldo Financeiro em 30/11/2020		21.997.069,79

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
Taxa de Juros Anual:	5,8800 %		
Índice de Inflação:		IPCA	
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.

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

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	out20	nov20	dez20	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 IDKA 2	R\$ 138.091.209,36	R\$ 140.197.967,29	-	1,3400	1,5256	2,8860%	2,8860%	NC
BRASESCO 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%
BRASESCO 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	out20	nov20	dez20	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

Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
			Saldo Financeiro em 31/12/2019
			22.151.234,44
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.

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

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	out20	nov20	dez20	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	out20	nov20	dez20	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	
TOTAL	R\$ 9.950.014,00	R\$ 10.436.196,24							

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\$
			Saldo Financeiro em 30/11/2019 3.260.451,82
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.

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

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	
Mês/Ano	Receitas R\$	Despesas R\$	Resultado R\$
		Saldo Financeiro em 31/12/2019	5.366.939.392,93
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 GERAF/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.

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

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.

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

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	out20	nov20	dez20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO 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	out20	nov20	dez20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO 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	out20	nov20	dez20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO 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	out20	nov20	dez20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO 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	out20	nov20	dez20	TRIMESTRE	2020	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO 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.

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

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				
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 89.848.523,89	15,47%	30%	40%	art. 7º, inciso IV, "a"
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 60.806.397,84				
BRDESCO 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				
BRDESCO 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.

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

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				
ITAÚ 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				
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 127.693.596,92				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 172.274.057,48				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 55.061.046,42				
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 245.501.673,60				
BTG ABSOLUTO INST. FQ 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%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 89.848.523,89	1,57%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 9.324.667,93	0,16%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 60.806.397,84	1,06%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 66.310.584,66	1,16%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 46.127.497,79	0,81%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 128.292.874,16	2,25%	
ITAU INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 64.400.324,94	1,13%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 831.659.583,30	14,56%	
ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 10.665.485,89	0,19%	
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 172.274.057,48	3,02%	
ITAU SMALL CAP VALUATION	R\$ 55.061.046,42	0,96%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 116.324.768,42	2,04%	
ITAU INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 127.693.596,92	2,24%	
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 245.501.673,60	4,30%	
ICATU VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 29.750.989,01	0,52%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 78.849.311,66	1,38%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 94.808.812,56	1,66%	
ICATU VANGUARDA 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 CRESCE 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\$ 245.863.748,76	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%	
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 89.848.523,89	08.246.263/0001-97	R\$ 422.999.839,93	21,24%	
BRDESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 9.324.667,93	03.399.411/0001-90	R\$ 3.168.557.239,02	0,29%	
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 60.806.397,84	20.216.216/0001/04	R\$ 954.945.016,55	6,37%	
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 66.310.584,66	28.515.874/0001-09	R\$ 1.422.915.185,87	4,66%	
BRDESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 46.127.497,79	14.099.976/0001-78	R\$ 595.178.322,17	7,75%	
BRDESCO 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\$ 48.825.960,66	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 VANGUARDA 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 VANGUARDA AÇÕES IBX 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\$ MI	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%	
BRADESCO	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	0,5198%	
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

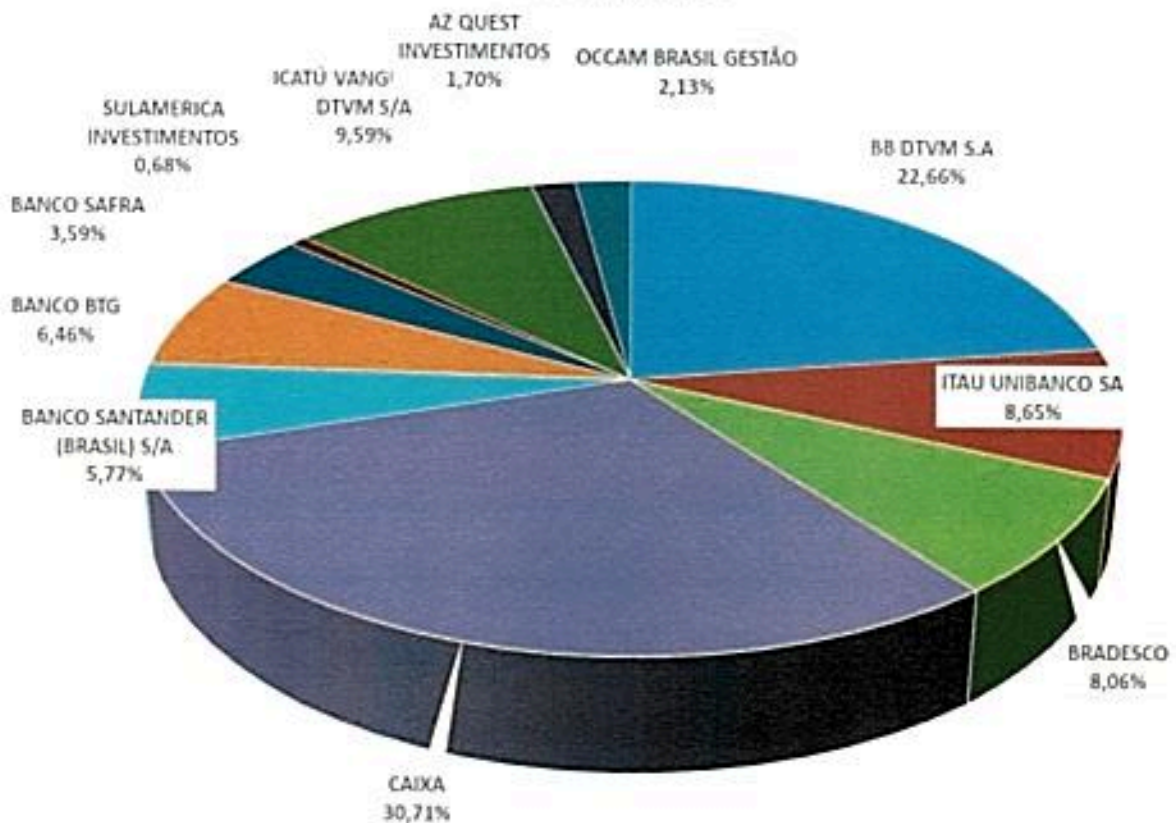


Gráfico 4.

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

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

Quadro 44.

EVOLUÇÃO DOS RECURSOS - AMAZONPREV

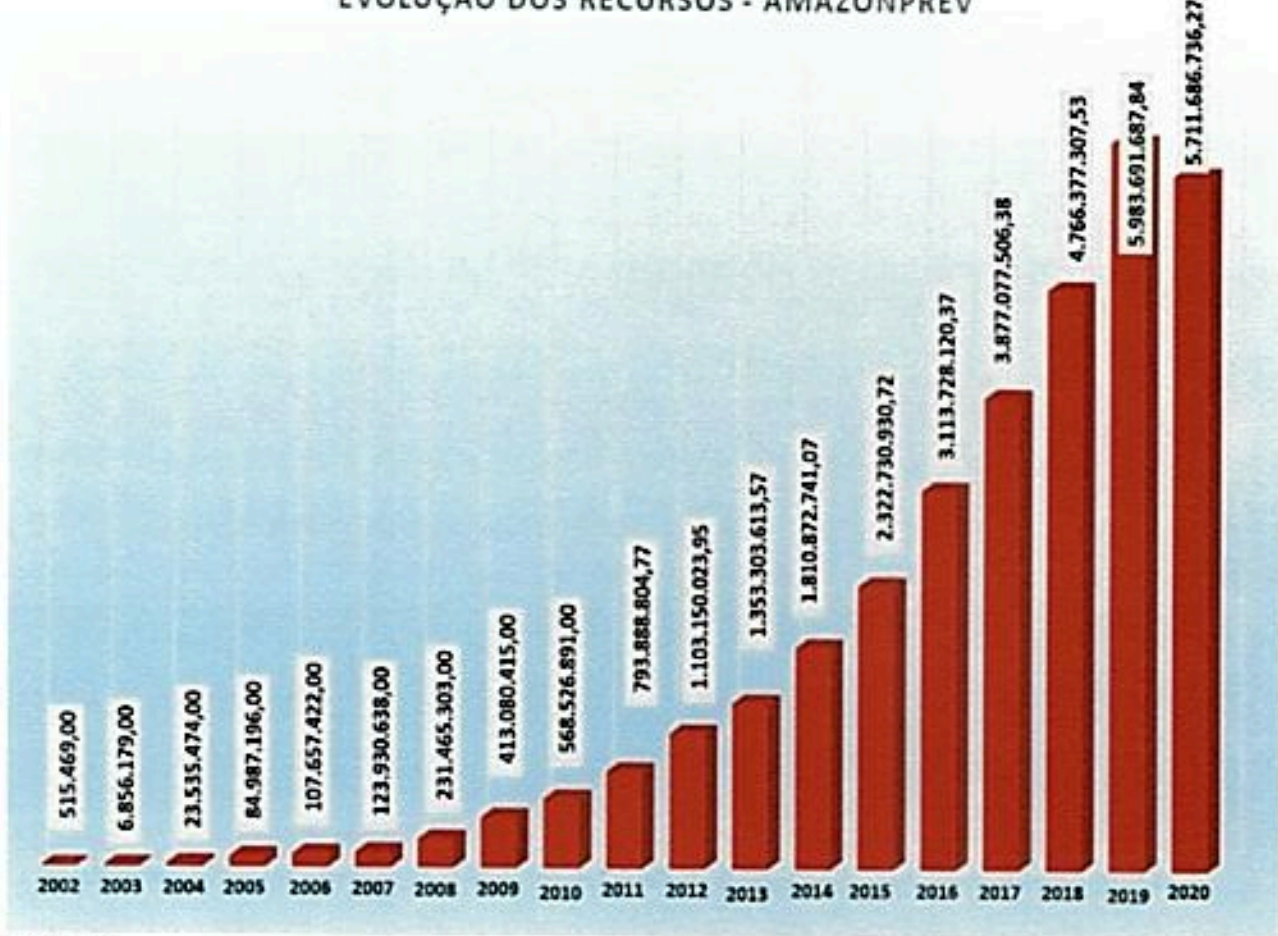


Gráfico 5.

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 STDR GLOBAL		
	Ícetu 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 GERAF/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.



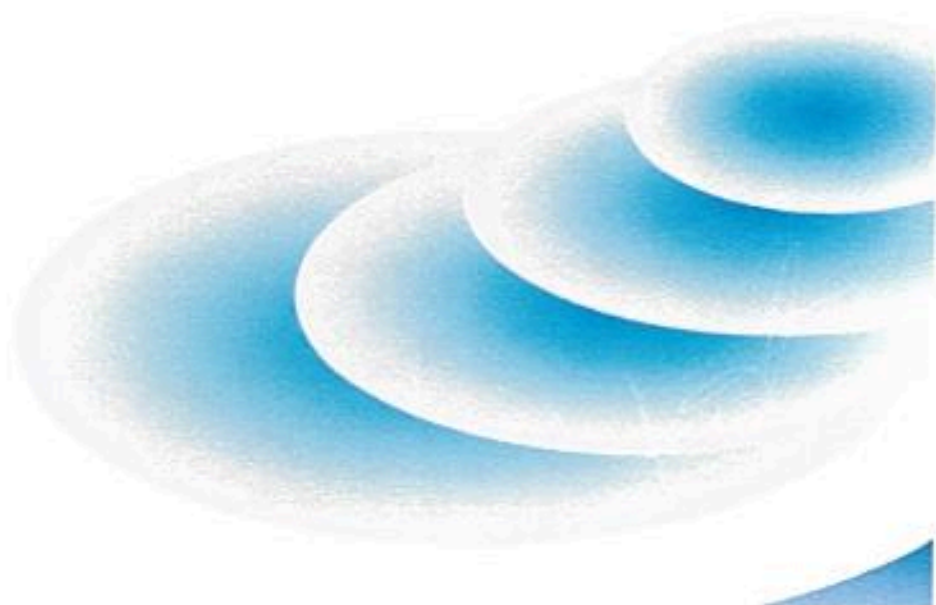
AMAZONPREV

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 Alocacao Ativa FcFI	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 Alocacao Dinamica	R\$ 60.985.284,88	6,90%	0,71%	-5,88	4,66%	2,48%	4,66%
Bradesco Inst FICFI RF Imo B 5	R\$ 60.806.397,84	5,37%	0,55%	-5,66	7,86%	1,78%	7,86%
Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	R\$ 2.002.164,94	0,32%	0,03%	-0,53	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 Imo 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 Gestao Estrategica RF	R\$ 794.651.183,95	5,93%	0,61%	-4,27	6,66%	1,32%	6,66%
Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	R\$ 29.750.989,01	6,07%	0,62%	-6,53	7,60%	2,37%	7,60%
Icatu Vanguardia Inflacao Curta FI RF LP	R\$ 78.849.311,66	5,22%	0,54%	-5,56	7,65%	1,81%	7,65%
Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	R\$ 94.808.812,56	19,82%	2,04%	-18,81	5,10%	7,50%	5,10%
Itau Inst Alocacao Dinamica RF FICFI	R\$ 64.400.324,94	1,66%	0,17%	-1,57	2,86%	0,20%	2,86%
Safrá Imo Institucional 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 Equiv 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%
Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	R\$ 34.706.335,56	44,21%	4,48%	-46,69	4,62%	9,43%	4,62%
BTG Pactual Absokto 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 Ibrx 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 Duramto 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%
Safrá S P Reas Pb FI Mult	R\$ 21.663.161,63	32,70%	3,36%	-34,78	12,58%	3,07%	12,58%
Safrá 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

Relatório de Investimentos – Dezembro/2020

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

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

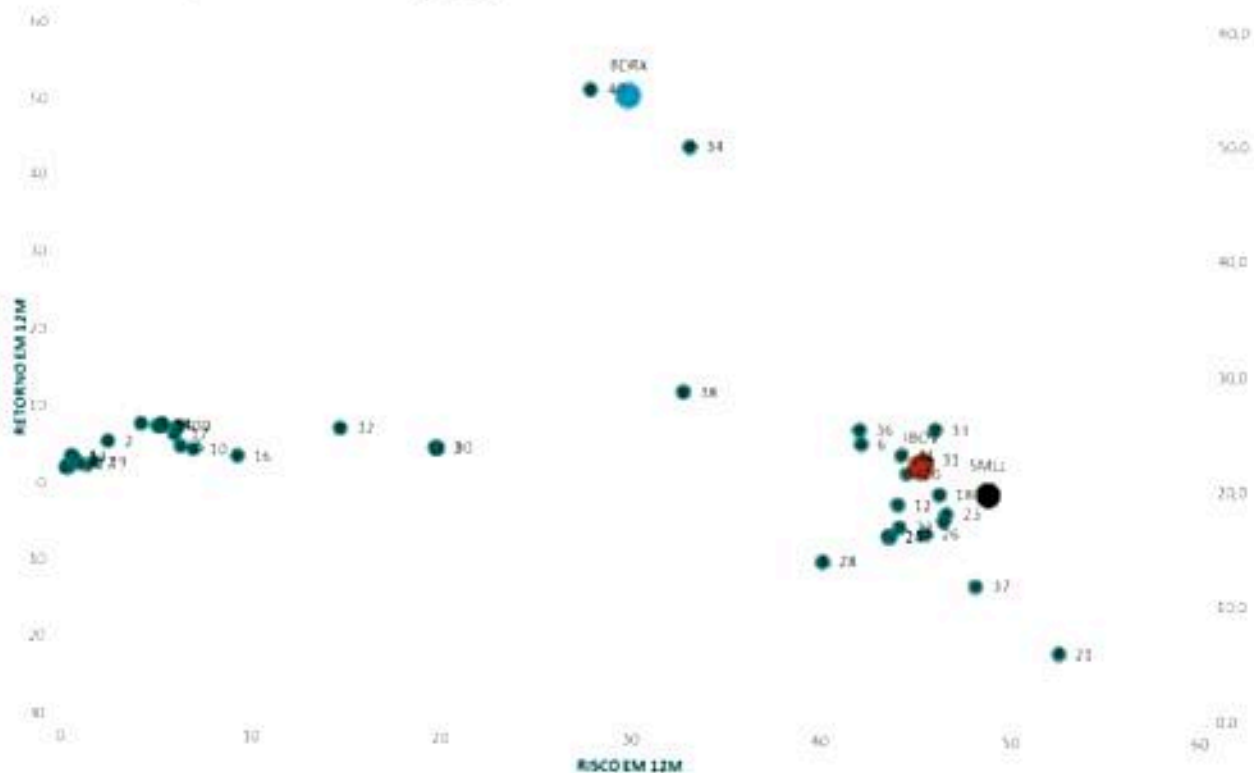


Gráfico 1: Análise Risco x Retorno (12 M)

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 Fc fi	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 Gestao Estrategica 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 Reals 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%
CB1	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%
NF	1,48	1,85%	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	103 058 071	22,2%
AA+	90 733 303	11,0%
AA	136 899 972	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	5 242 044	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)

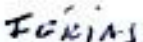
PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

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.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT13NDU4



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%
BRADESCO 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%
BRADESCO 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
BRADESCO 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 VANGUARDA 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: MIT3NDU4



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 EIA	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	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO
PREÇO UNITÁRIO DE COMPRA	R\$ 2.314,742871	R\$ 2.288,539269	R\$ 2.235,637189	R\$ 2.254,343911
QUANTIDADE	43.100	43.450	44.113	44.350
APLICAÇÃO INICIAL	R\$ 99.765.417,74	R\$ 99.437.031,23	R\$ 98.620.663,31	R\$ 99.980.152,45
VALOR ATUAL	R\$ 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 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: MT13NDU4



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 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.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MIT3NDU4



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 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: MIT3NDU4



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	
ICATU 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 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 GUIMARÃES 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

007

2.4 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

1. Investimentos - Assembléia

Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
Saldo dos Investimentos em 12/2020			R\$ 15.166.901,59
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

Item	Em 12 meses	No ano	No mês
Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
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%
BRADESCO 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%
BRADESCO 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
BRADESCO 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.

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: MIT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

008

3.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

1. Investimentos - Ministério Público

Saldo dos Investimentos em 12/2020	RS 169.242.211,10
------------------------------------	-------------------

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

Saldo dos Investimentos em 12/2021	RS 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\$	RS -3.830.617,72	RS -3.830.617,72	RS 3.040.439,14
Resultado em %	-15,6735 %	-15,6735 %	+0,4738 %
Resultado em R\$	RS -32.647.074,45	RS -32.647.074,45	RS +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: MTT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

009

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%
BRADESCO 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%
BRADESCO 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%
BRADESCO 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%
BRADESCO 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 AÇORES 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

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\$ 51.462,27	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 12/2020			R\$ 25.328.013,69
Saldo dos Investimentos em 12/2021			R\$ 39.429.548,44

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

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.

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: MIT3NDU4



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%
BRABESCO 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%
BRABESCO 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%
BRABESCO 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 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 GUIMARÃES 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: MIT3NDU4



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%
BRADERCO 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%
BRADERCO 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%
BRADERCO 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 AÇORES 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 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: MIT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

012

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.

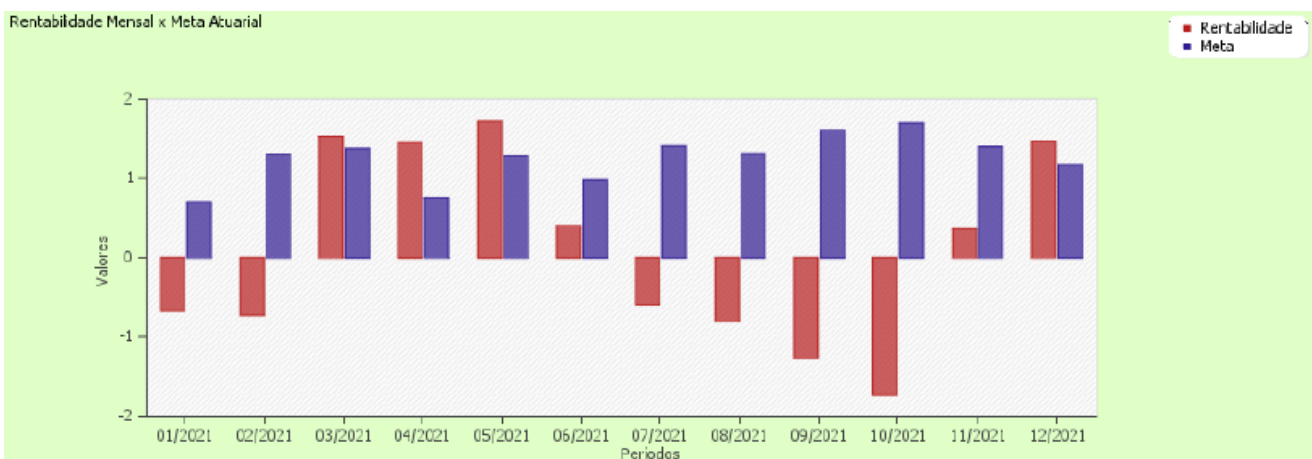


Gráfico 1.

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: MIT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

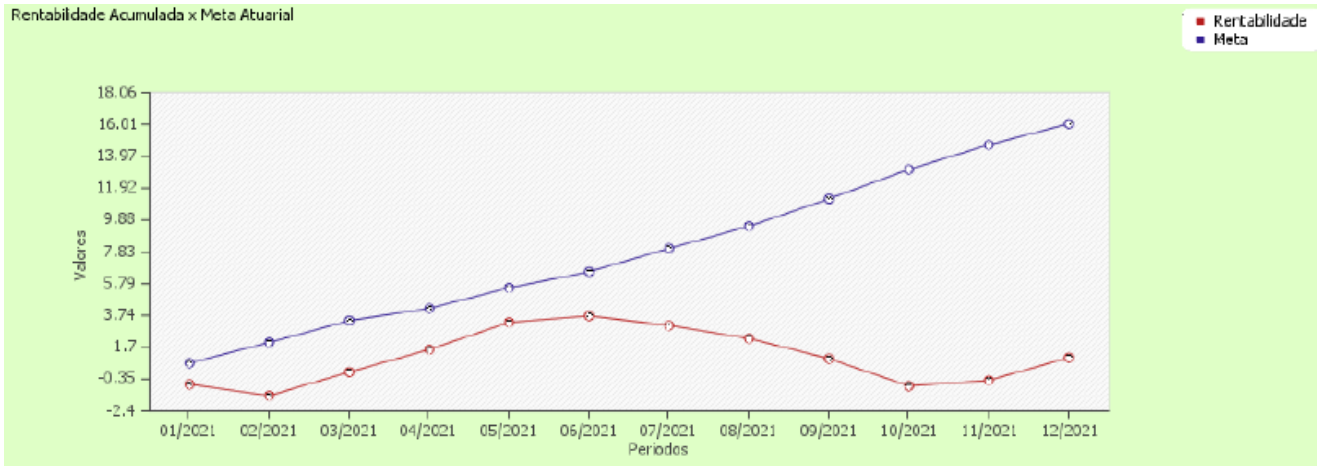


Gráfico 2.

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: MTI3NDU4



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 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 GUIMARÃES 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



8.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRDESCO 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
BRDESCO 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
BRDESCO 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
BRDESCO 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.

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: MIT3NDU4



9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

9.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRADESCO 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
BRADESCO 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
BRADESCO 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
BRADESCO 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
BRADESCO 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 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: MT13NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

017

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 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 GUIMARÃES 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: MIT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

018

10.1 RENDA VARIÁVEL

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÃO	RESGATE	RENDIMENTO	SALDO	VARIAÇÃO (%)
BRDESCO 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%
BRDESCO 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%
SCHRÖDER 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 ACOES	R\$ -	R\$ 21.000.000,00	R\$ -	-R\$ 3.757.246,89	R\$ 17.242.753,11	-17,892%
CAIXA FIC FIA BRASIL ACOES 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 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: MIT3NDU4



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								
ITAU 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 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.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

020

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	
BRDESCO 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				
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				
BRDESCO 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	23,64%	30,00%	30,00%	art. 8º, inciso II, "a"
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				
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 25.348.996,11	3,30%	3,00%	3,00%	art. 8º, inciso III
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				
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.256.195,85	0,38%	2,00%	5,00%	art. 8º, inciso IV, "a"
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				
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 41.389.565,28				
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 34.417.308,95	5,30%	5,00%		art 9º-A, inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 154.235.894,63			10,00%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 32.233.514,06				
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo 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 GUIMARÃES 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: MIT3NDU4



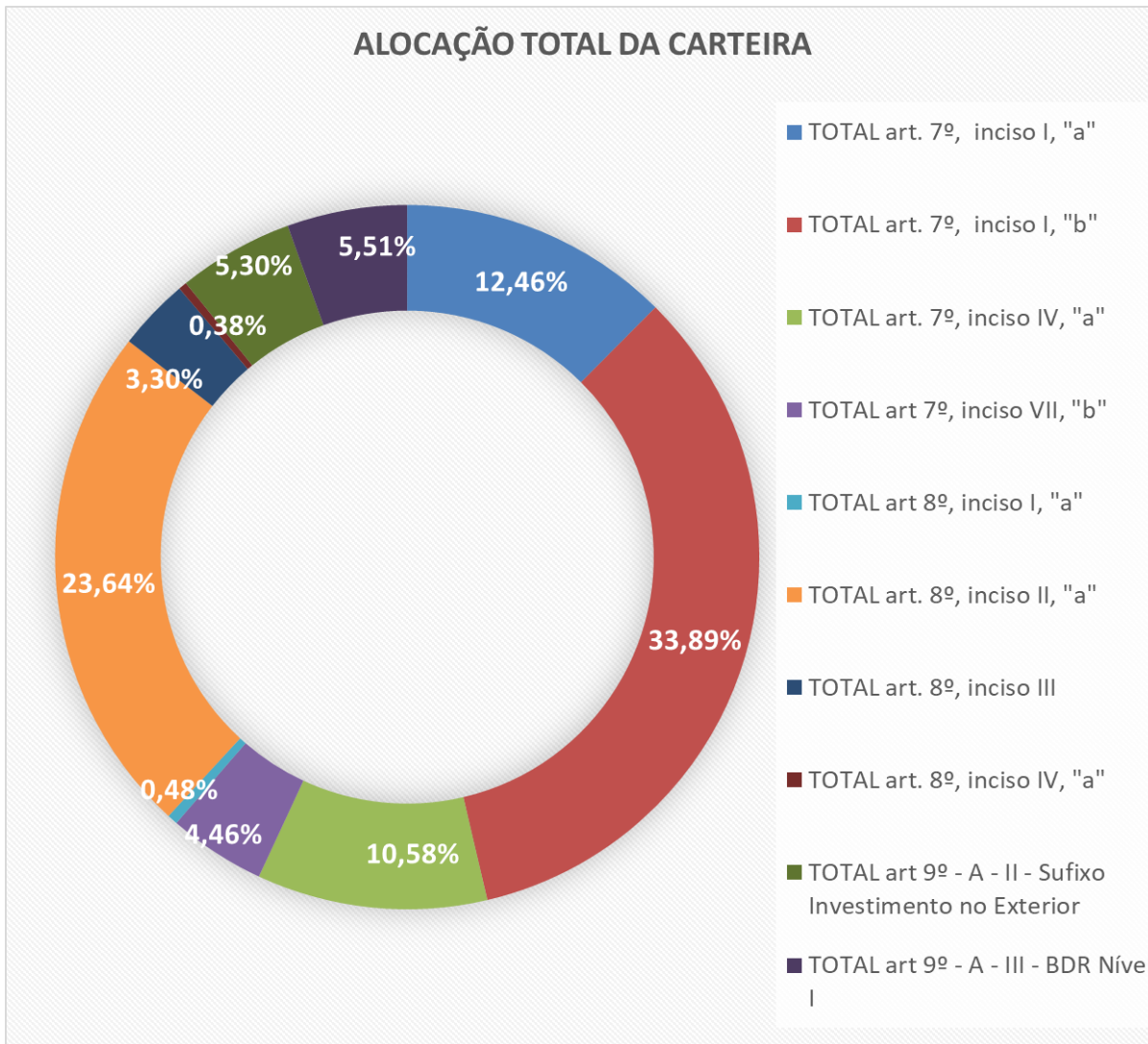


Gráfico 3.

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
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTT3NDU4



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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% CARTEIRA	Resolução CMN n° 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. FQ 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%	
ITAÚ 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 CRESCE 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 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: MIT3NDU4



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	RS 7.120.337,67	RS 248.037.532,98	2,87%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	RS 509.729.128,82	RS 9.277.694.744,55	5,49%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	RS 422.765.060,34	RS 7.701.081.218,58	5,49%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	RS 122.788.669,99	RS 1.098.659.963,05	11,18%	
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	RS 50.145.820,90	RS 1.417.181.864,81	3,54%	
BB FIA BDR - NIVEL I	RS 168.086.619,73	RS 2.396.743.051,17	7,01%	
BB MM GLOBAL SELECT	RS 58.238.540,61	RS 2.529.172.574,05	2,30%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	RS 70.456.237,12	RS 631.584.812,26	11,16%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	RS 38.055.548,57	RS 3.276.976.164,01	1,16%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	RS 58.608.058,65	RS 1.241.205.562,42	4,72%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	RS 49.182.492,16	RS 1.152.512.113,97	4,27%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	RS 28.731.850,34	RS 503.177.927,29	5,71%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	RS 152.999.296,21	RS 1.419.483.989,90	10,78%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	RS 492.367.703,98	RS 12.444.051.491,75	3,96%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	RS 53.538.599,32	RS 218.489.919,55	24,50%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	RS 640.552.889,09	RS 12.561.638.596,69	5,10%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	RS 113.119,53	RS 2.626.754.965,66	0,00%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	RS 34.095.419,66	RS 723.867.535,77	4,71%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	RS 157.617.379,80	RS 2.631.453.374,95	5,99%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	RS 104.186.789,94	RS 923.668.055,52	11,28%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	RS 12.327,77	RS 166.923.439,39	0,01%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	RS 154.235.894,63	RS 2.180.881.081,62	7,07%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	RS 77.192.701,48	RS 999.787.061,37	7,72%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	RS 93.399.609,36	RS 824.519.977,45	11,33%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	RS 112.463.180,56	RS 604.309.300,74	18,61%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	RS 138.946.928,62	RS 1.091.655.164,39	12,73%	
BTG ABSOLUTO INST. FIO FIA	RS 228.949.493,23	RS 1.896.702.011,80	12,07%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	RS 164.986.079,35	RS 3.983.843.860,12	4,14%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	RS 76.459.160,97	RS 1.900.035.039,47	4,02%	
OCCAM FIC FIA	RS 82.731.675,55	RS 1.010.020.909,77	8,19%	
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	RS 97.670.543,70	RS 1.094.729.532,50	8,92%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	RS 26.804.565,85	RS 368.066.288,15	10,59%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	RS 38.984.655,51	RS 542.903.933,54	5,72%	
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT	RS 31.063.490,15	RS 506.222.631,32	6,14%	
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	RS 38.807.964,00	RS 873.571.747,14	4,44%	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	RS 41.389.565,28	RS 135.056.267.739,99	0,03%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	RS 34.417.308,95	RS 37.339.613.996,37	0,09%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	RS 7.941.806,13	RS 87.352.824,95	9,09%	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	RS 8.130.314,94	RS 205.904.381,47	3,95%	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	RS 46.984.364,62	RS 476.428.583,05	9,86%	
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	RS 17.242.753,11	RS 154.789.214,50	11,14%	
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	RS 28.159.398,55	RS 703.850.641,65	4,00%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	RS 32.233.514,06	RS 19.919.461.267,17	0,16%	
TOTAL	RS 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	RS 64.523.928,69	RS 2.394.295.587,10	2,69%	5%
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	RS 109.828.928,93	RS 2.374.573.482,34	4,63%	
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	RS 25.348.996,11	RS 385.338.764,40	6,58%	
BTG ECONOMIA REAL FIP	RS 13.828.108,17	RS 993.885.542,59	1,39%	
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	RS 9.256.195,85	RS 186.152.675,59	4,97%	
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	RS 35.021.379,46	RS 1.405.415.305,82	2,49%	
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	RS 34.040.408,86	RS 777.989.992,71	4,38%	
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	RS 107.652.513,38	RS 1.904.562.600,94	5,65%	
ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC FI	RS 61.624.409,75	RS 1.907.070.007,57	3,23%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	RS 31.195.468,15	RS 1.086.649.624,61	2,87%	
TOTAL	RS 492.320.337,35			
TOTAL	RS 5.290.907.196,15			

Quadro 43.

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 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: MIT3NDU4



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%	
ICATU 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 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: MIT3NDU4



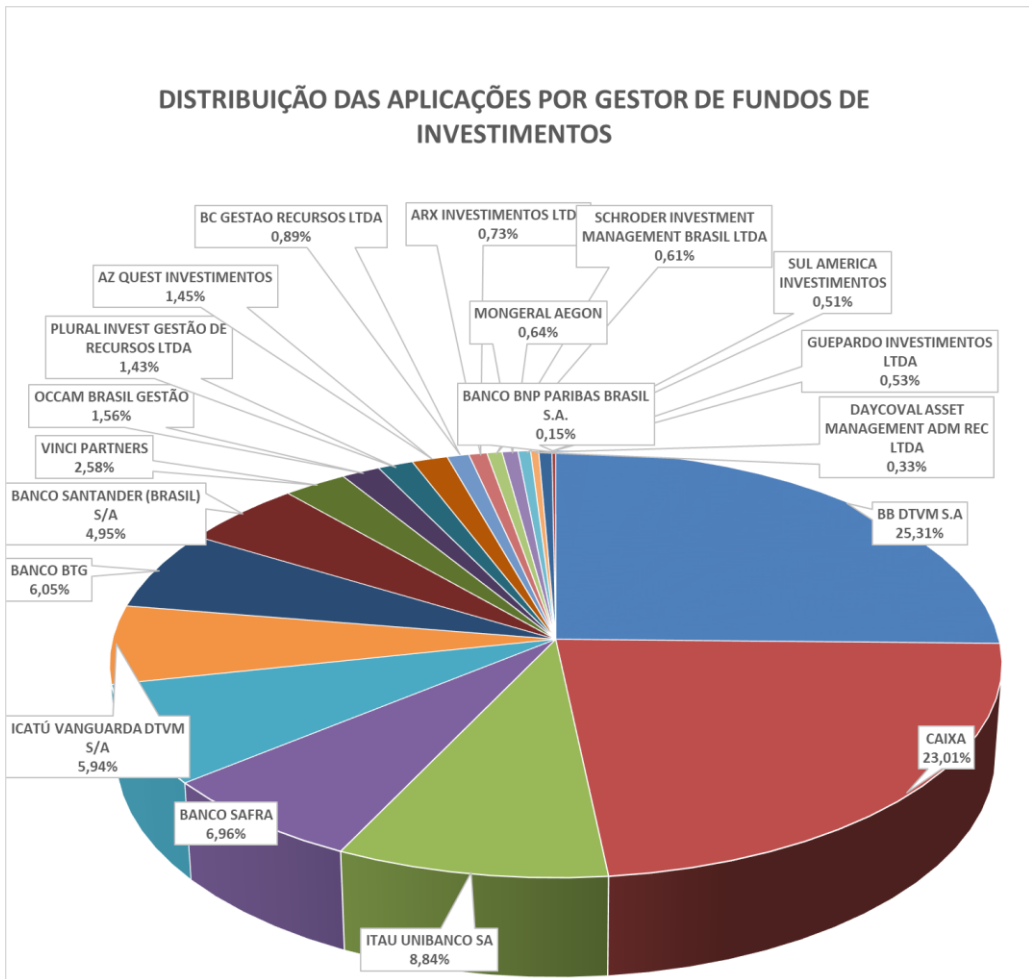


Gráfico 4.

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 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
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTT3NDU4



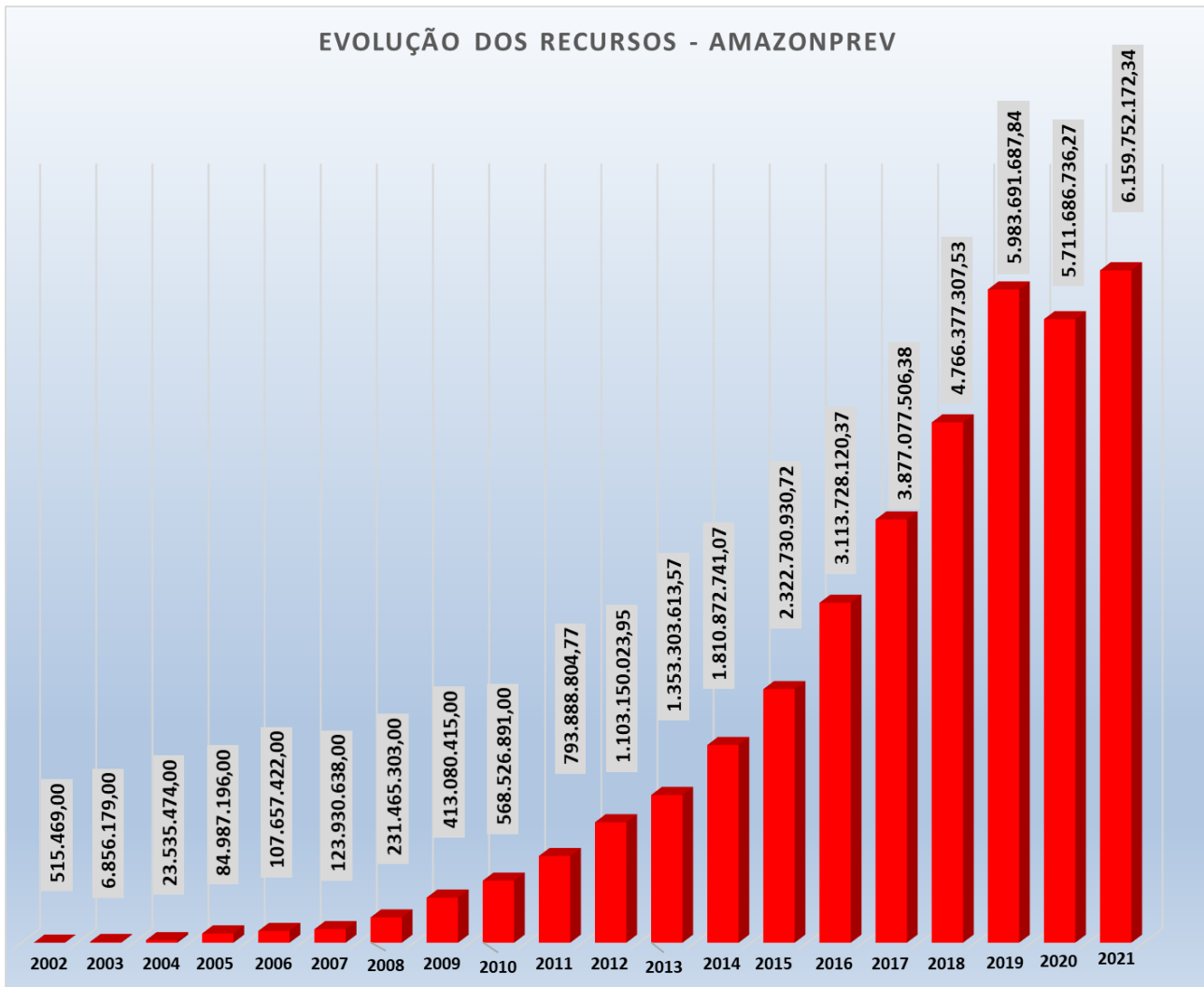


Gráfico 05.



AMAZONPREV
Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



***RELATÓRIO DE
RISCOS
FPREV -
AMAZONPREV***

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: MT13NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

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	dez21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
TÍTULOS PÚBLICOS DO TESOUREIRO	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	dez21	2021
							RETORNO	RETORNO	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	dez21	2021
							RETORNO	RETORNO	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	dez21	2021
							RETORNO	RETORNO	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.



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	MáxDrowdown 12M	12M	dez/21	2021
							RETORNO	RETORNO	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	MáxDrowdown 12M	12M	dez/21	2021
							RETORNO	RETORNO	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 Absolut 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 Selecao 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 Selecao 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	MáxDrowdown 12M	12M	dez/21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
Saifa 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	MáxDrowdown 12M	12M	dez/21	2021
							RETORNO	RETORNO	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	MáxDrowdown 12M	12M	dez/21	2021
							RETORNO	RETORNO	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 Nível I	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	dez/21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Acoes Esg FIA - Bdr Nível 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%
Saifa Consumo Americano FIA Bdr Nível 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 Nível I	R\$ 322.687.141,81	R\$ 333.072.699,08							

Quadro 2.

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

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.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MIT3NDU4



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, 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.



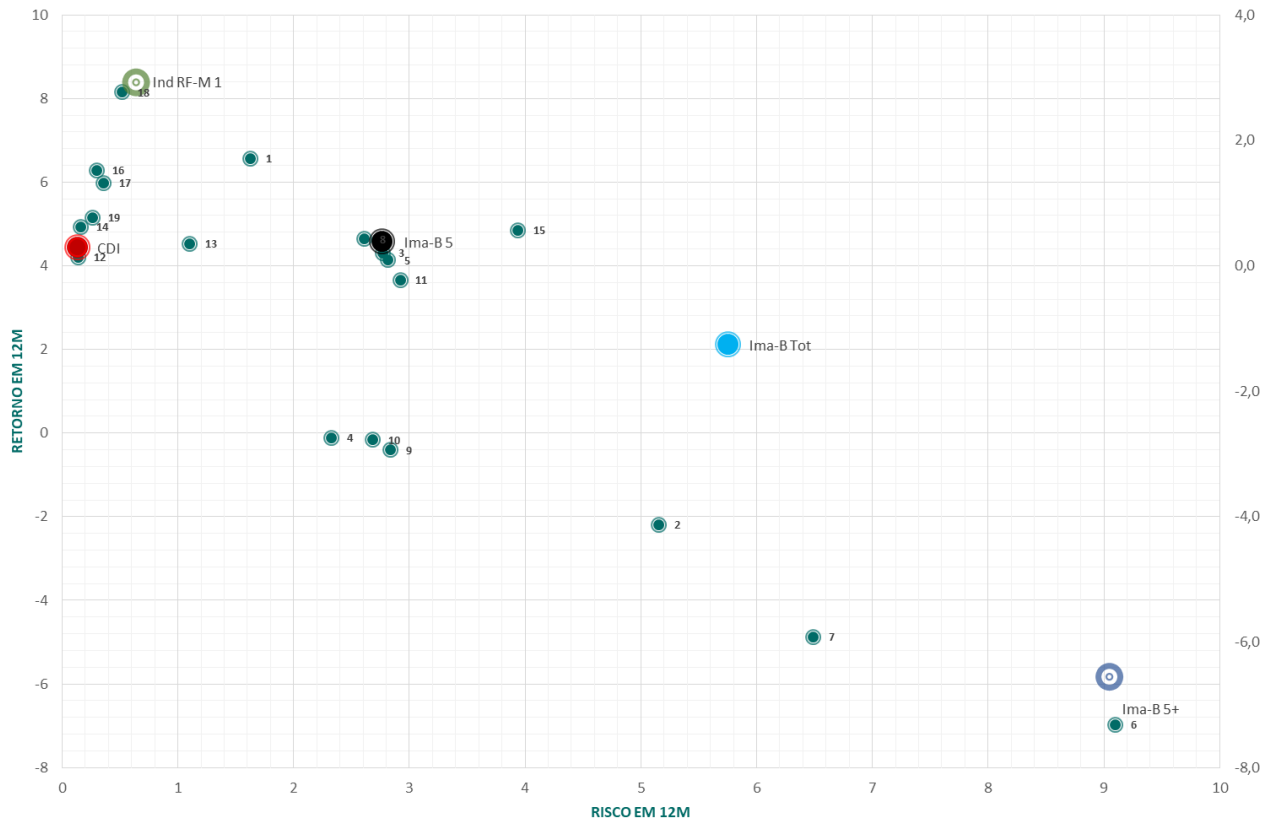


Gráfico 1: Art. 7º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

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 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: MIT3NDU4





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 GUIMARÃES 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
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTT3NDU4



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 Selecao 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 Selecao 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.

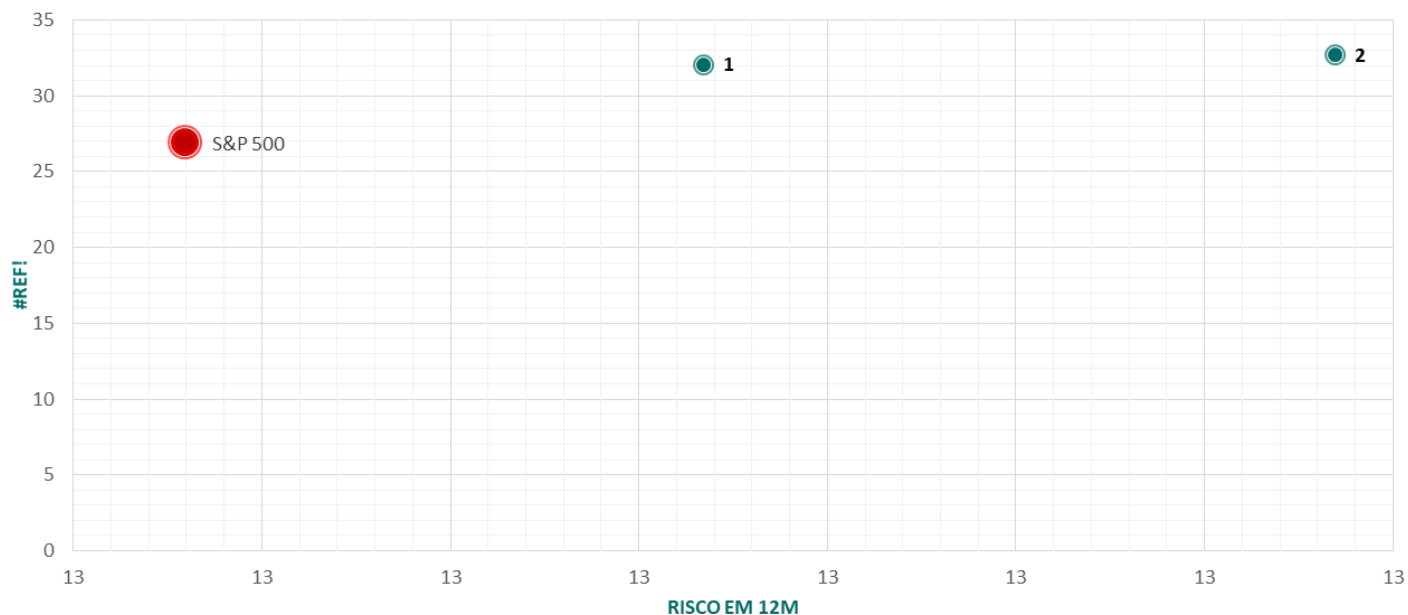


Gráfico 3: Art. 8-III,º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

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 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.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MIT3NDU4



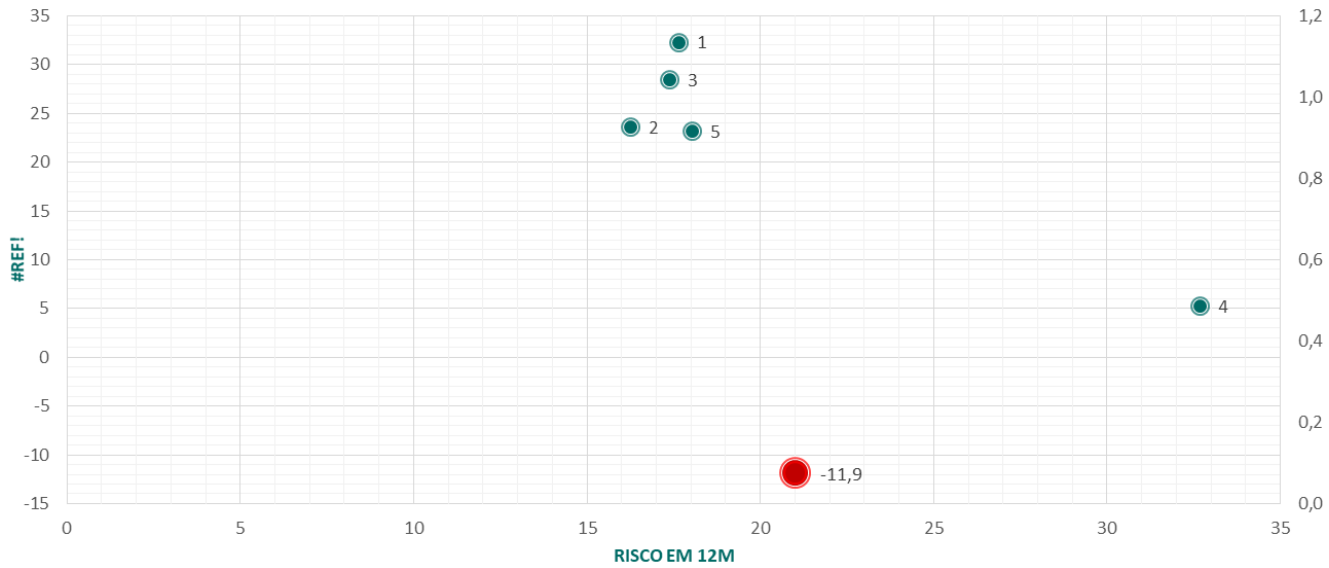


Gráfico 4: Art. 9º-A-II Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

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.

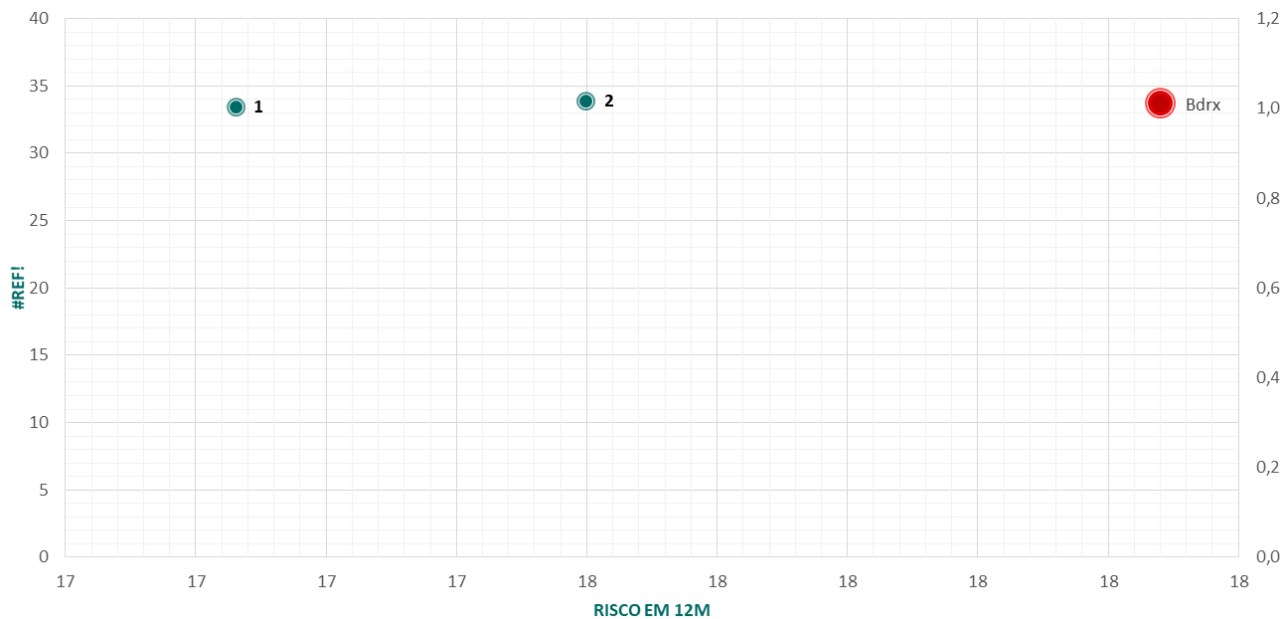


Gráfico 5: Art. 9-A-IIIº Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

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: MTT3NDU4



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	Safra Consumo Americano FIA Bdr Nível I	33,92	17,50	D+001	D+004

Quadro 6. Legenda Gráfico 5.

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: MT13NDU4



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: MT13NDU4



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: MjczNJE1



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).



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 AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjczNJE1



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 VANGUARDA 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 NIVEL 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 NIVEL 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.portaldosegurado.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: MjczNJE1



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



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.



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

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 12/2021			R\$ 5.135.114.780,63
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.



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	
ICATU 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.portaldosegurado.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 AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjczNJE1



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 AMAZONAS
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 AMAZONAS
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.



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 AÇOES 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 AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjczNJE1



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: MjczNJE1



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 AÇOES 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: MjczNJE1



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 TJAM 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 AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjczNJE1



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 AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjczNJE1



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: MjczNJE1



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 Recursos	30/12/2022	% dos Recursos
	SALDO		SALDO	
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.



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.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjczNJE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

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

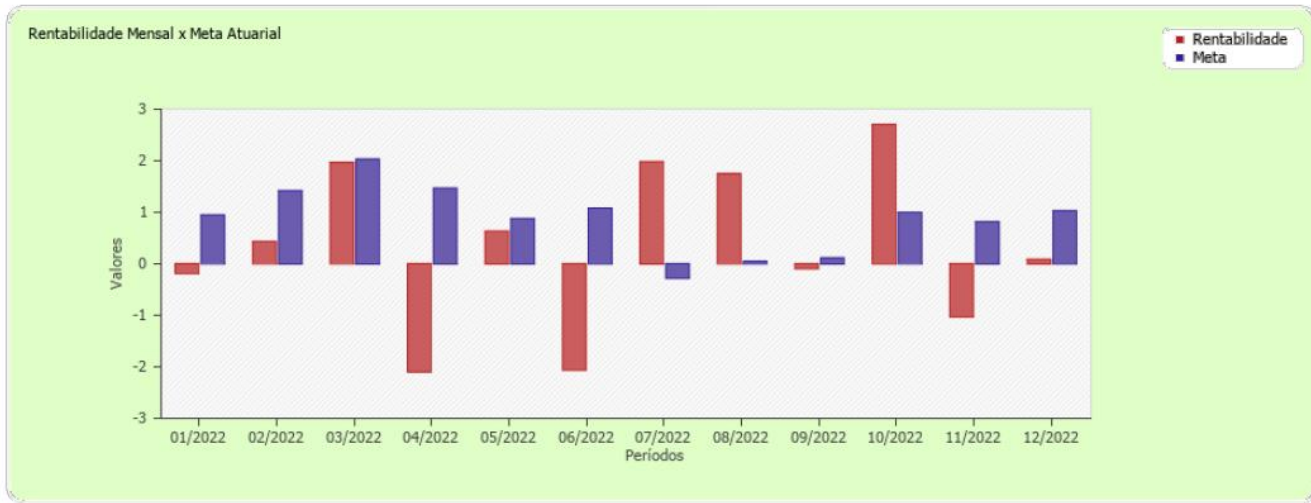


Gráfico 1.

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

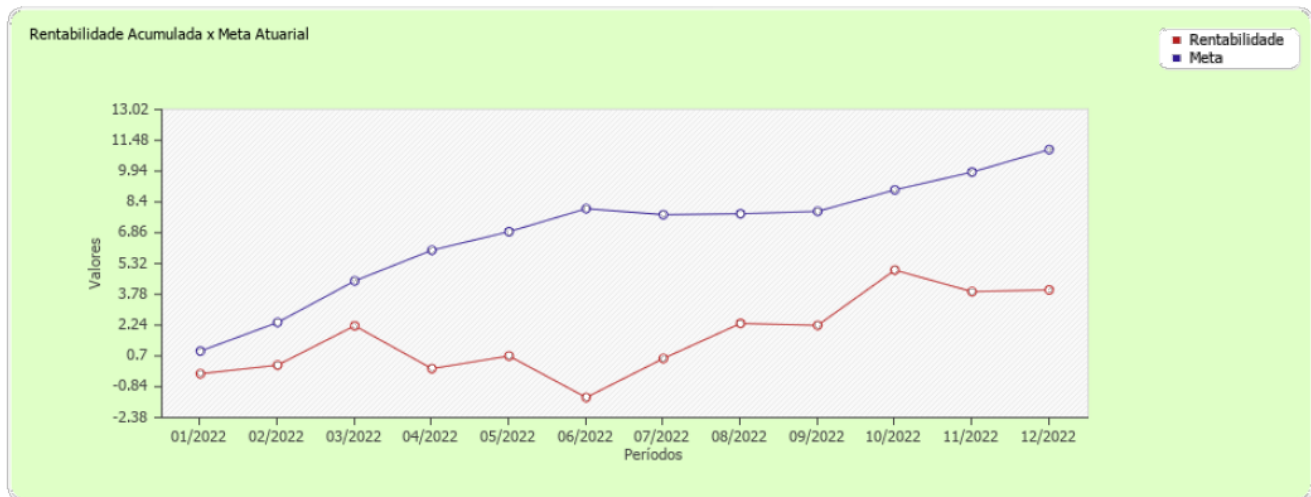


Gráfico 2.

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: MjczNJE1



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 AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.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

Quadro 41.

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

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: MjczNJE1



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 AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjczNJE1



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 TESOUREO 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 MACTH 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 AMAZONAS

Acesse: <https://www.portaldesegurado.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				
BRADERCO 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 VANGUARD 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				
ITAU BDR NÍVEL I 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 AMAZONAS
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	BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 30.459.468,00	0,44%	20%
	BRADESCO 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	ICATÚ 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%	
	BRADESCO 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%	
	ICATÚ 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%
	ITAU BDR NIVE I 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.portaldosegurado.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%	
	ITAU 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%	
	ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 93.874.541,89	R\$ 1.879.797.625,43	4,99%	
	ITAU 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%
	ITAU BDR NIVEL I 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 MULTIMERCADO	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%	
	ITAU 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.portaldosegurado.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%	
BRASESCO	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.

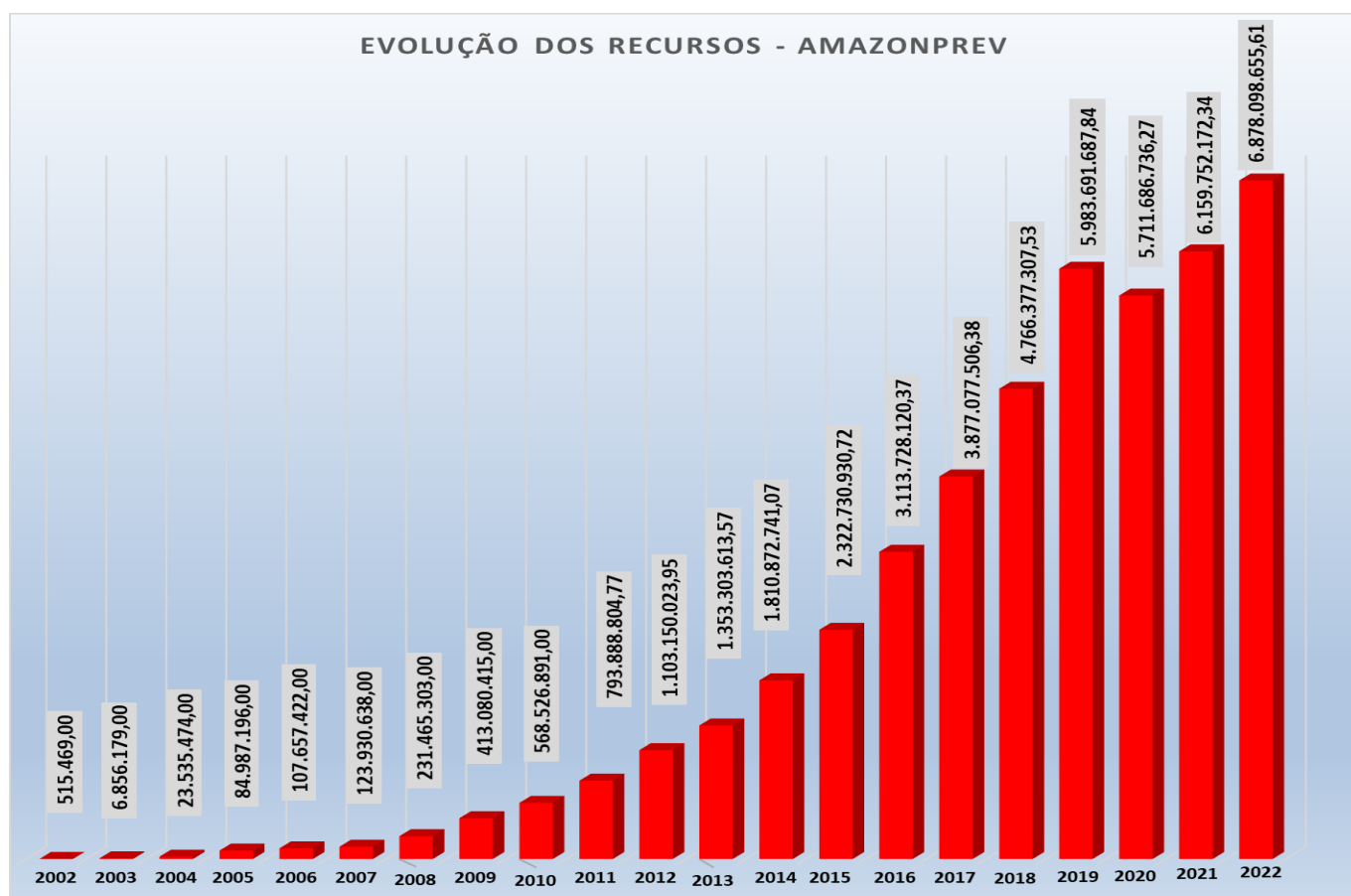


Gráfico 03



RELATÓRIOS - 2022

RELATÓRIO DE RISCOS FPREV - AMAZONPREV

Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjczNJE1

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 TESOUREIRO	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 Ref 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 AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjczNJE1



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: 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 AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjKzNjE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	dez/22	2022
						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						
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	dez/22	2022
BB Acoes Esg Is FIA -Bdr Nivel 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 Nivel 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 Nivel 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						
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS TOTAL art 10º, I, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	dez/22	2022
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						
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS TOTAL art 10º, I, "b"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	dez/22	2022
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.

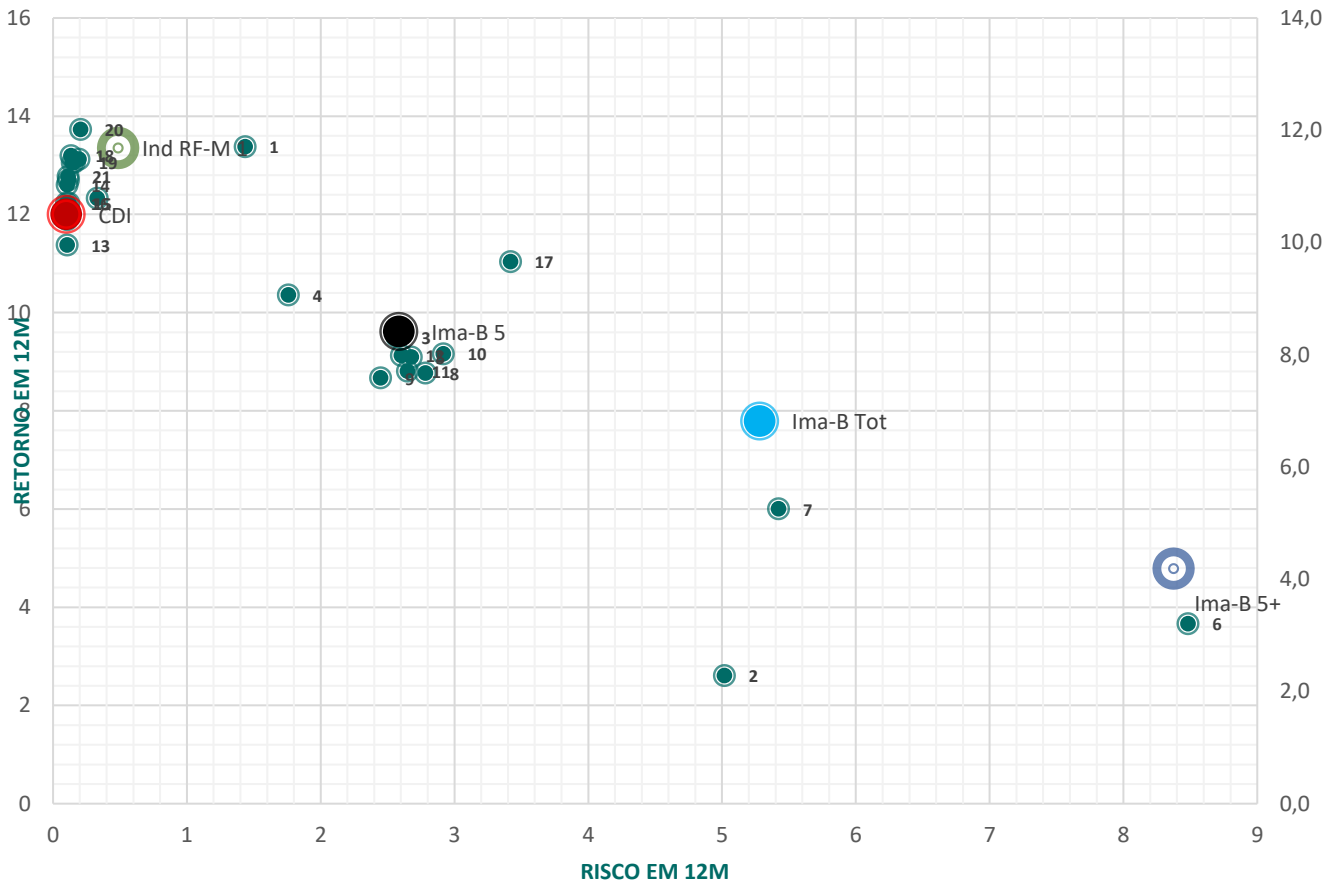


Gráfico 1: Art. 7º Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)

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

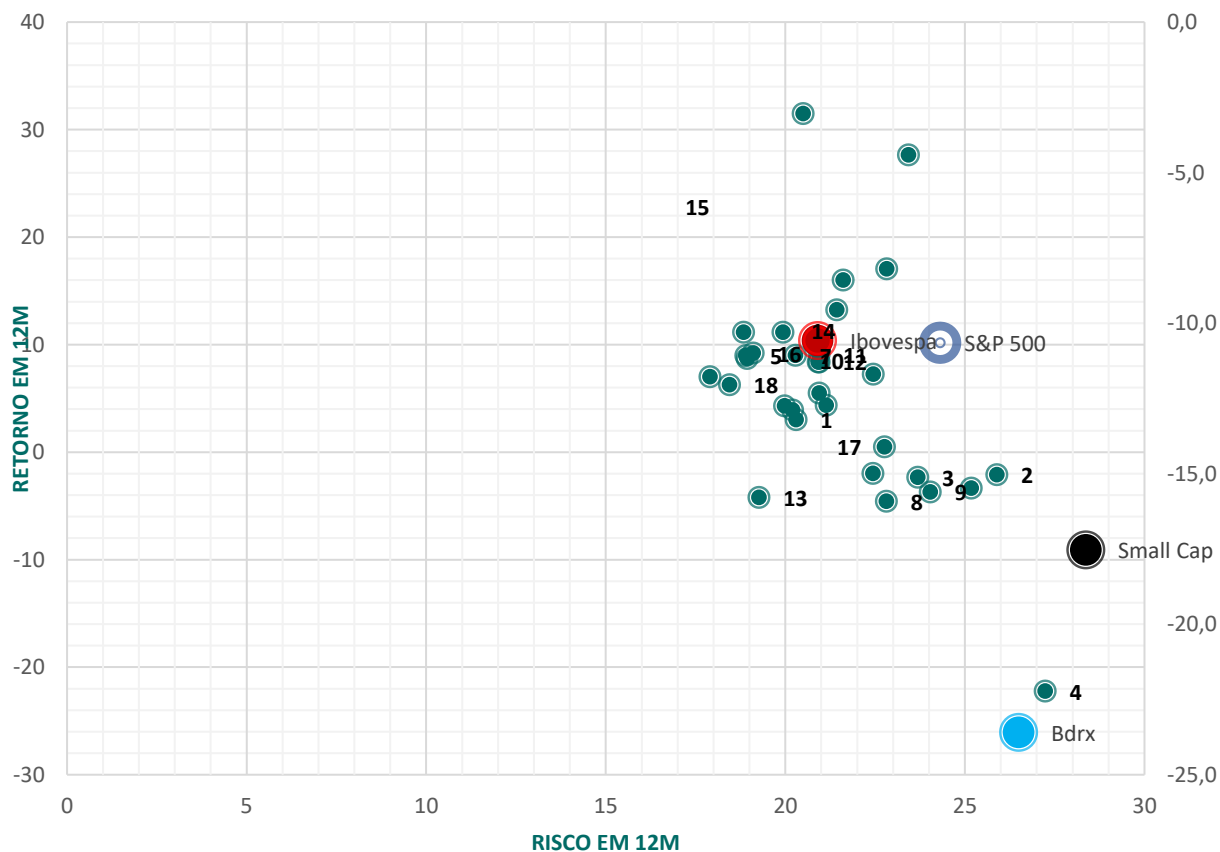
Documento assinado eletronicamente 293615/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjKzNjE1



Relatório Anual de Investimentos – Exercício de 2022

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art. 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 Alocao Ativa Fcfi	8,67	2,45	D+003	D+003
10	art. 7º, inciso I, "b"	Itau Instit Alocao Dinamica RF FICFI	9,16	2,92	D+000	D+001
11	art. 7º, inciso III, "a"	Bradesco Fc FI RF Alocao 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 Selecao 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 Selecao 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 Selecao 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.

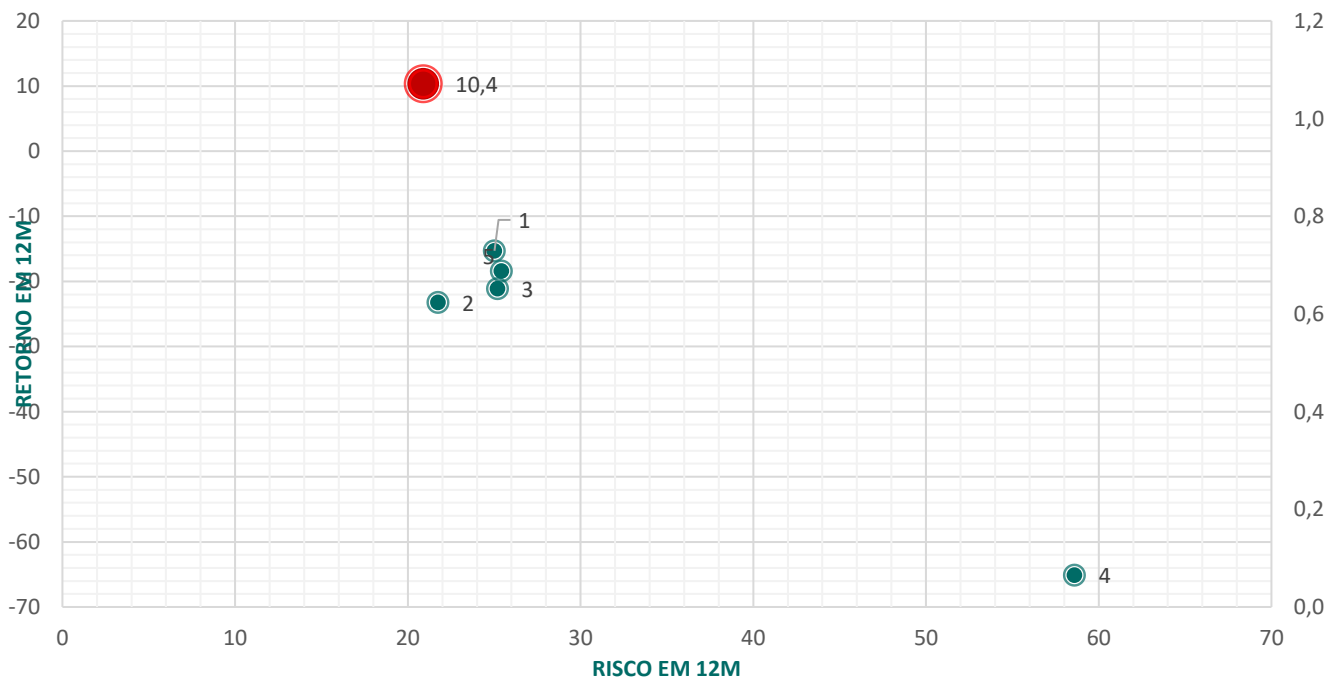


Gráfico 3: Art. 9-A-IIº Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)

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.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 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.

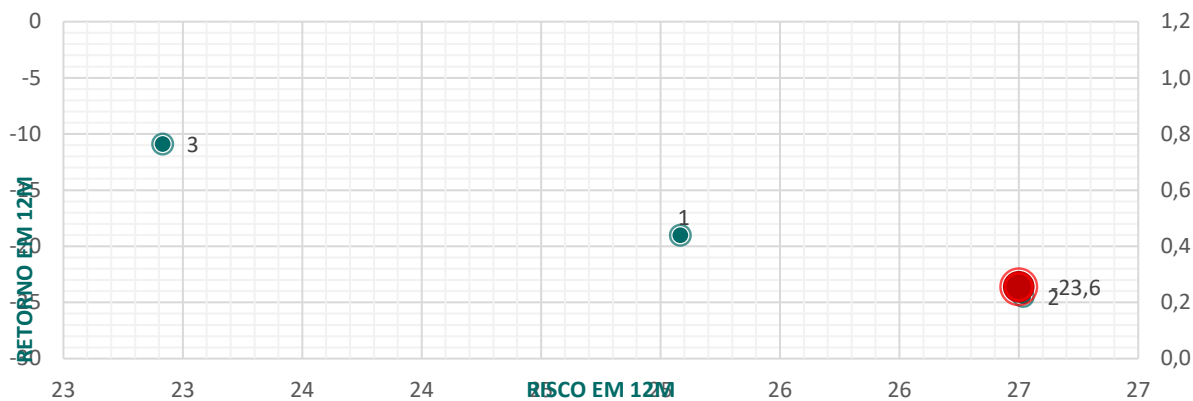


Gráfico 4: Art. 9-A-IIIº Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)

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 Nivel I	-19,03	25,08	D+001	D+004
2	art 9º - A - III - BDR Nível I	Safra Consumo Americano FIA Bdr Nivel I	-24,46	26,52	D+001	D+004
3	art 9º - A - III - BDR Nível I	Itau Acoes Bdr Nivel I Fc	-10,90	22,92	D+001	D+003

Quadro 7. Legenda Gráfico 4.

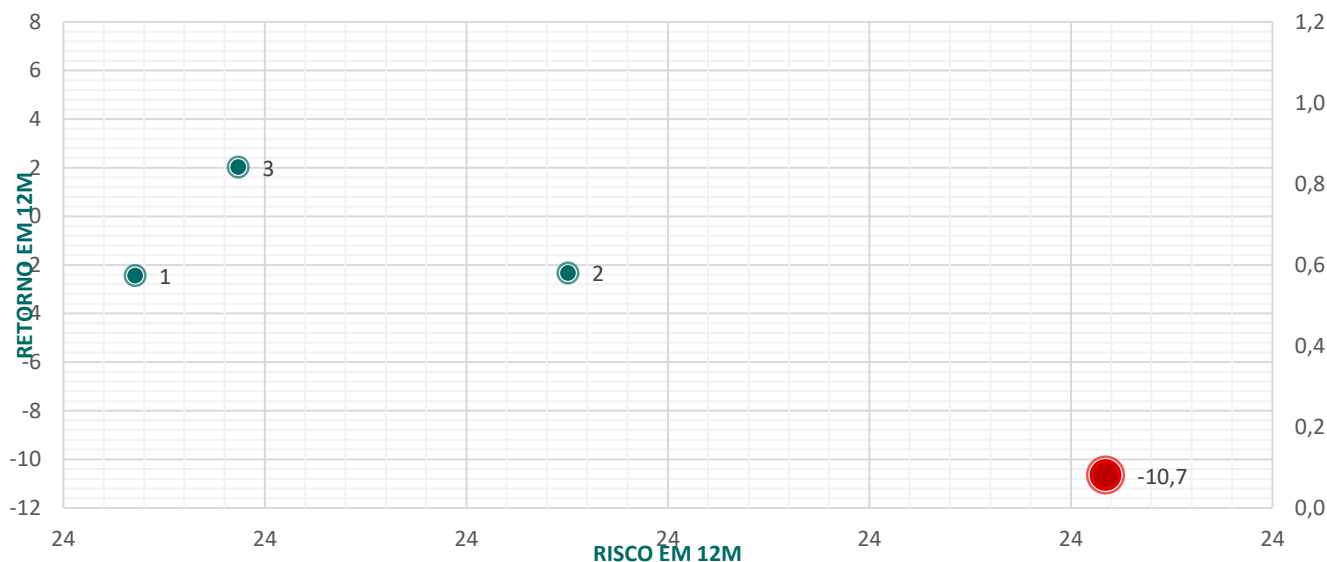


Gráfico 5: Art. 10º Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)

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 AMAZONAS
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 AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTgo



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 AMAZONAS
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 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

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 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: NDUjNTgo



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%
BRADESCO 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	
BRADESCO 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 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
 Acesso: <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 AÇOES	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 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
 Acesso: <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 AMAZONAS
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	15/08/2033	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 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
 Acesso: <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 (\$)
BRADESCO	R\$ 470.417.753,33
BANCO DO BRASIL	R\$ 440.586.134,91
CAIXA	R\$ 439.982.357,81
ITAU	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 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
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDUjNTg0



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

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
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDJyNTgo



2.6 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA (%)

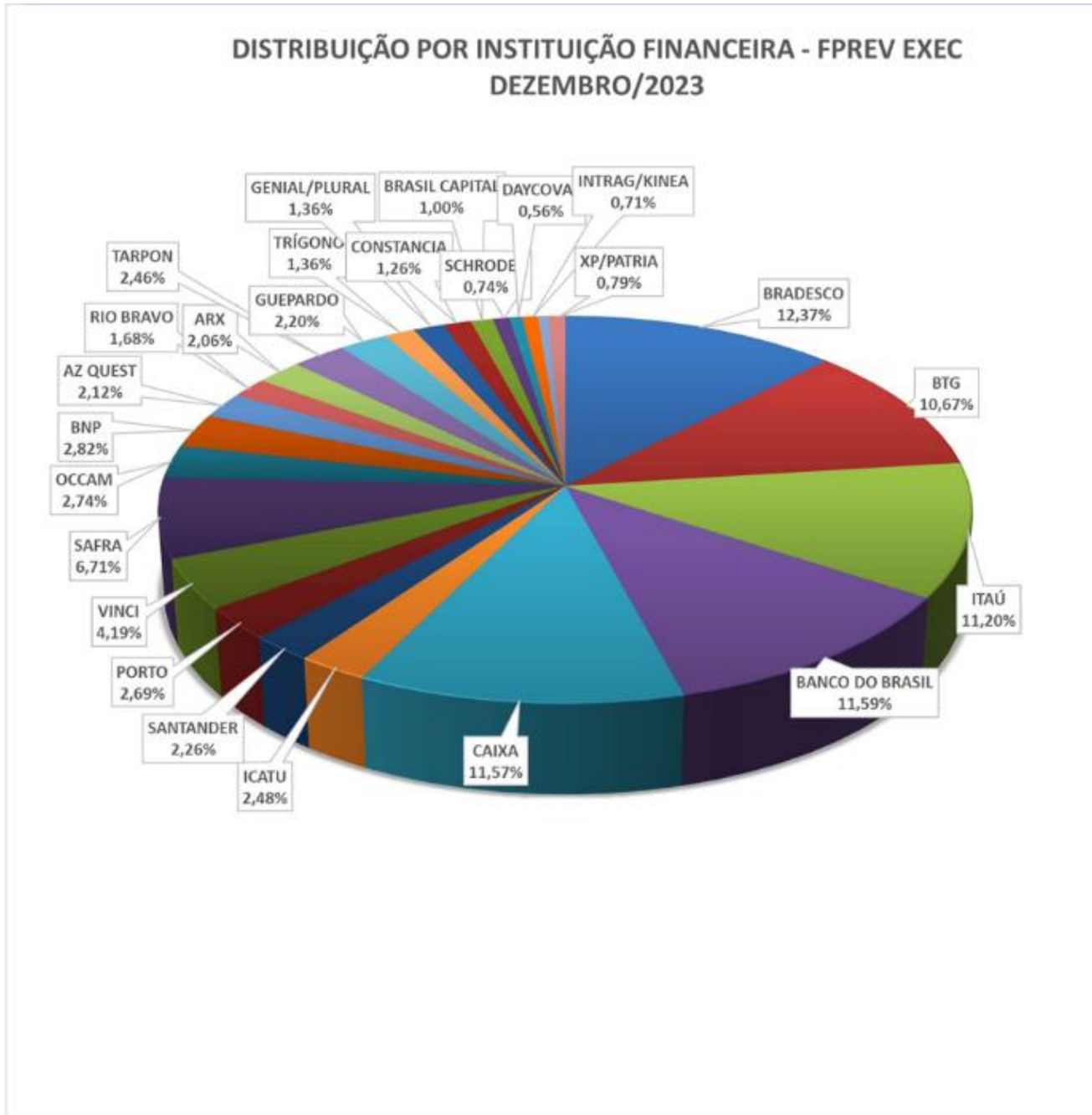


Gráfico 01

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 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
 Acesso: <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 AMAZONAS
 Acesso: <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 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
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.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	
BRANCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 1.129.200,94	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 1.129.200,94	
BTG 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%
BTG 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 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
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDJyNTgo



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

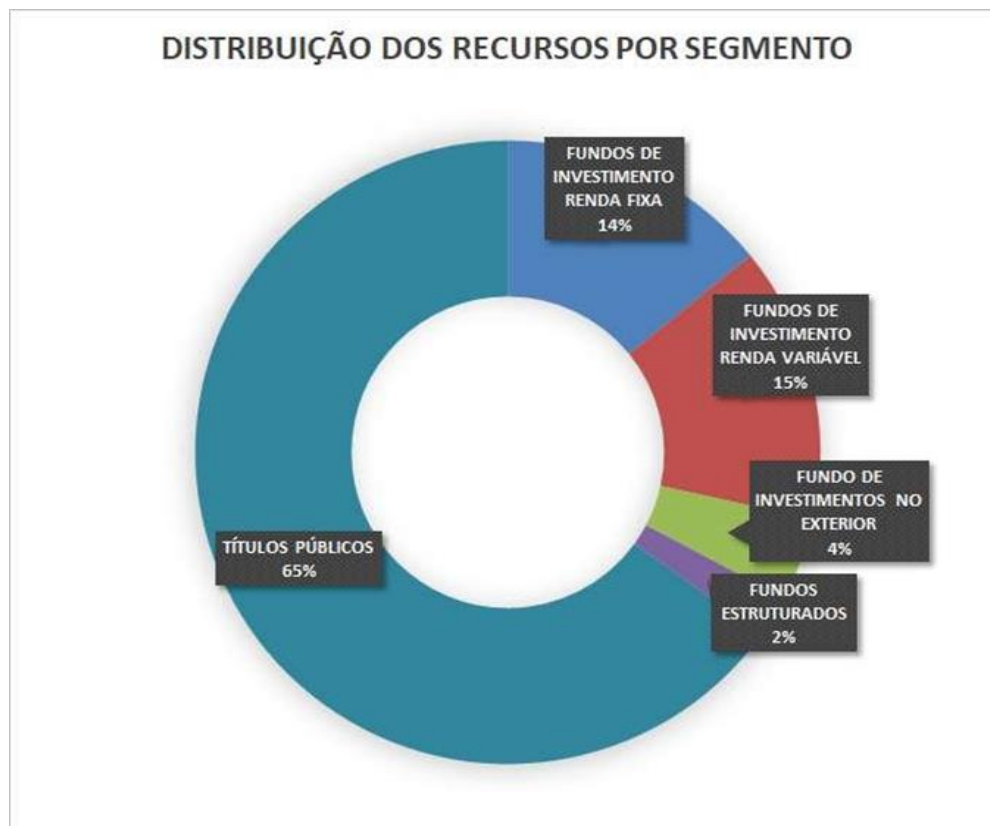


Gráfico 02

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 AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.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
 Acesso: <https://www.portaldesegurado.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 AÇOES 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 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
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDUyNTgo



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 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
 Acesso: <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 13:16:28
 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
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDJyNTg0



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 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
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDJyNTg0



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

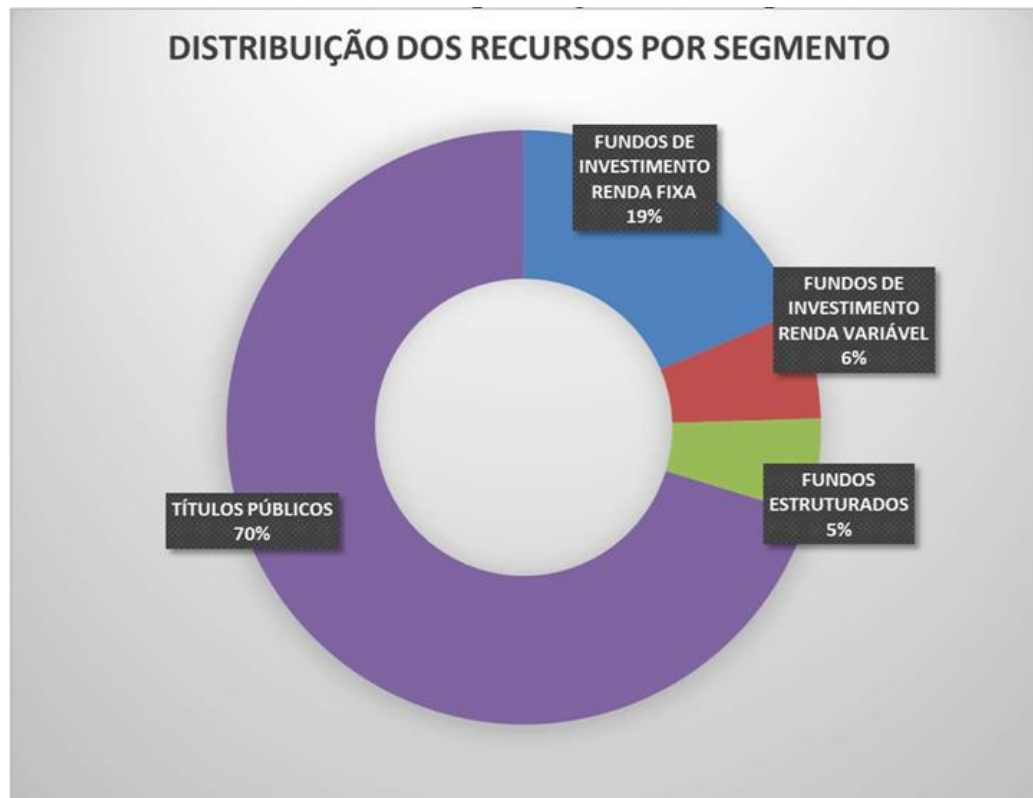


Gráfico 04

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 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
 Acesso: <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 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
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDUjNTg0



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
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.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 AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

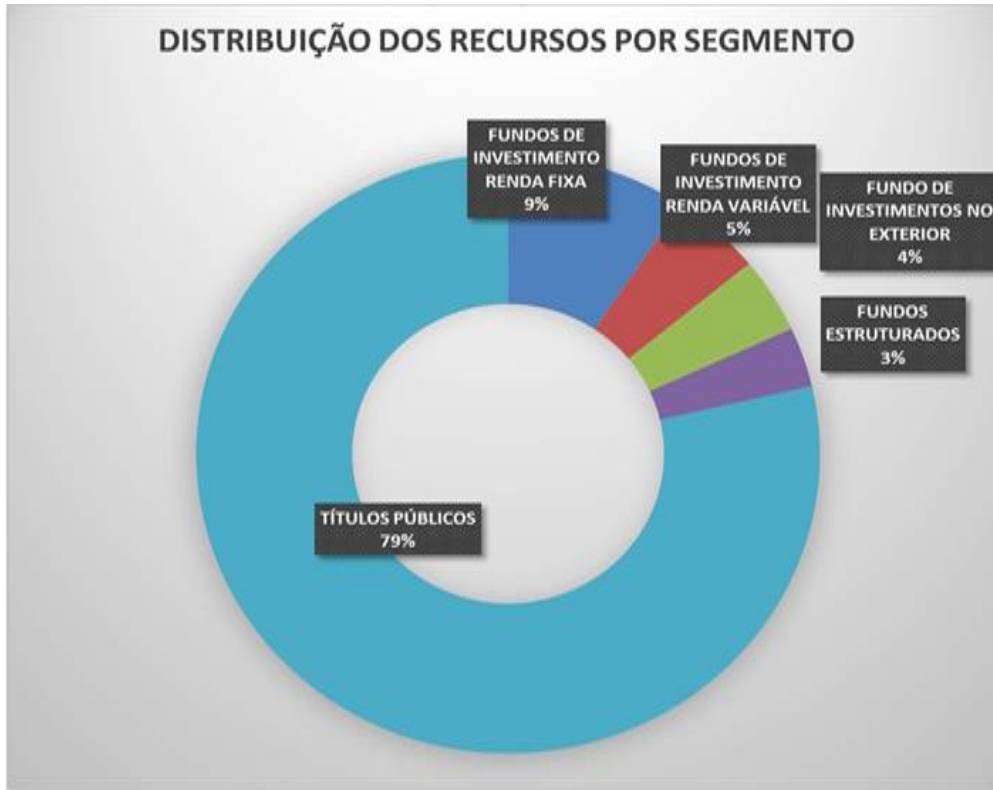


Gráfico 05

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 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
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDUjNTgo



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%
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 3.929.784,29	8,99%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 7.784.131,92	
BRADESCO 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 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
 Acesso: <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

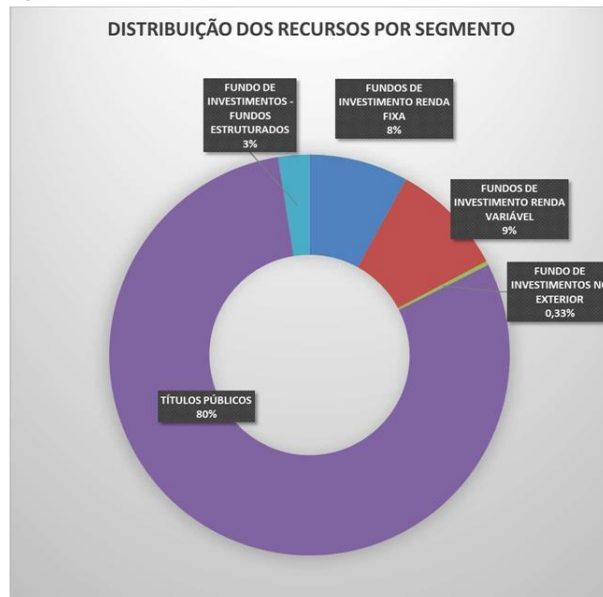


Gráfico 06

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 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
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDJyNTgo



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 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
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDUjNTgo



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 13:16:28
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: NDJyNTg0



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 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 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
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDJyNTg0



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
 Acesso: <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 AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.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 AMAZONAS
 Acesso: <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 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
 Acesso: <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 TESOUREO 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 PRÓPRIO 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								
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 66.072.686,38								
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 913.779.999,53								
BRADESCO 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
 Acesso: <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 FIA 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 INSTUCIONAL 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				
ITAÚ BDR NIVEL I 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
 Acesso: <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

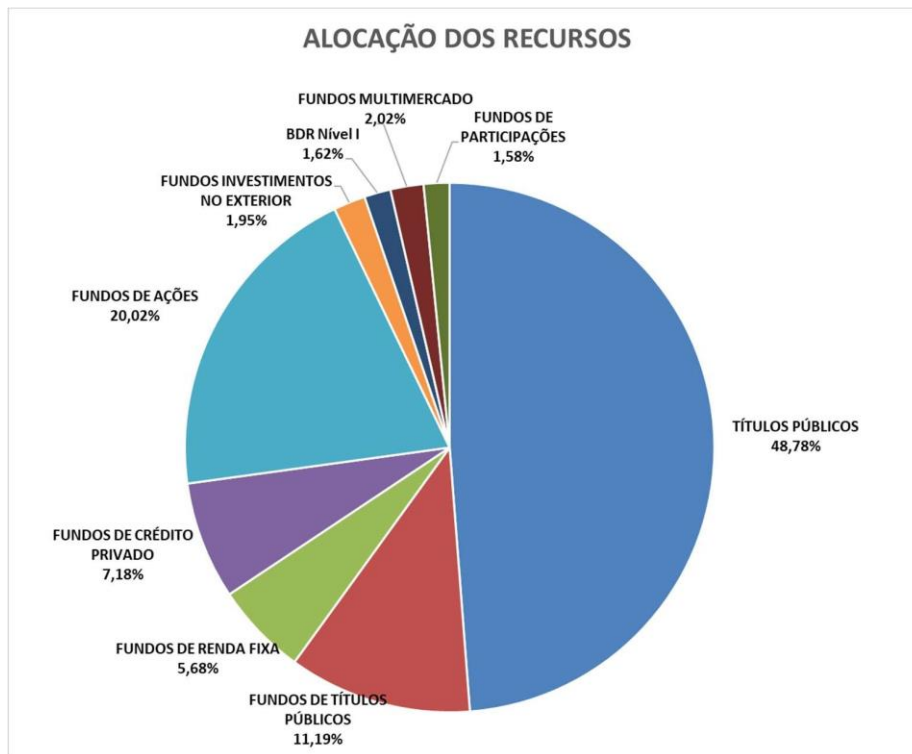


Gráfico 07

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 AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldesegurado.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	BRADESCO 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 PROPRIO 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%	20%
	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 22.417.071,02	0,27%	
	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 441.625.241,79	5,36%	
FI RF CREDITO PRIVADO	SANTANDER CRED PRIV CRESCEMENT 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%	
	BRADESCO 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 INSTTUCIONAL 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 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

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
 Acesso: <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%	
	ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 99.671.232,49	R\$ 2.228.464.987,02	4,47%	
FI RENDA FIXA	BRABESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 441.625.241,79	R\$ 10.247.341.113,60	4,31%	15%
	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%	
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 57.931.366,07	R\$ 1.630.113.546,20	3,53%	
	ITAÚ 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 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

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 compram cotas de fundos de investimentos deve ser considerado, para fins de cumprimento deste artigo, o Patrimônio Líquido do fundo máster, conforme Art. 118 da Portaria 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 parag. 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 AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDlyNTg0



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%	
BRADESCO	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
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDJyNTg0



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

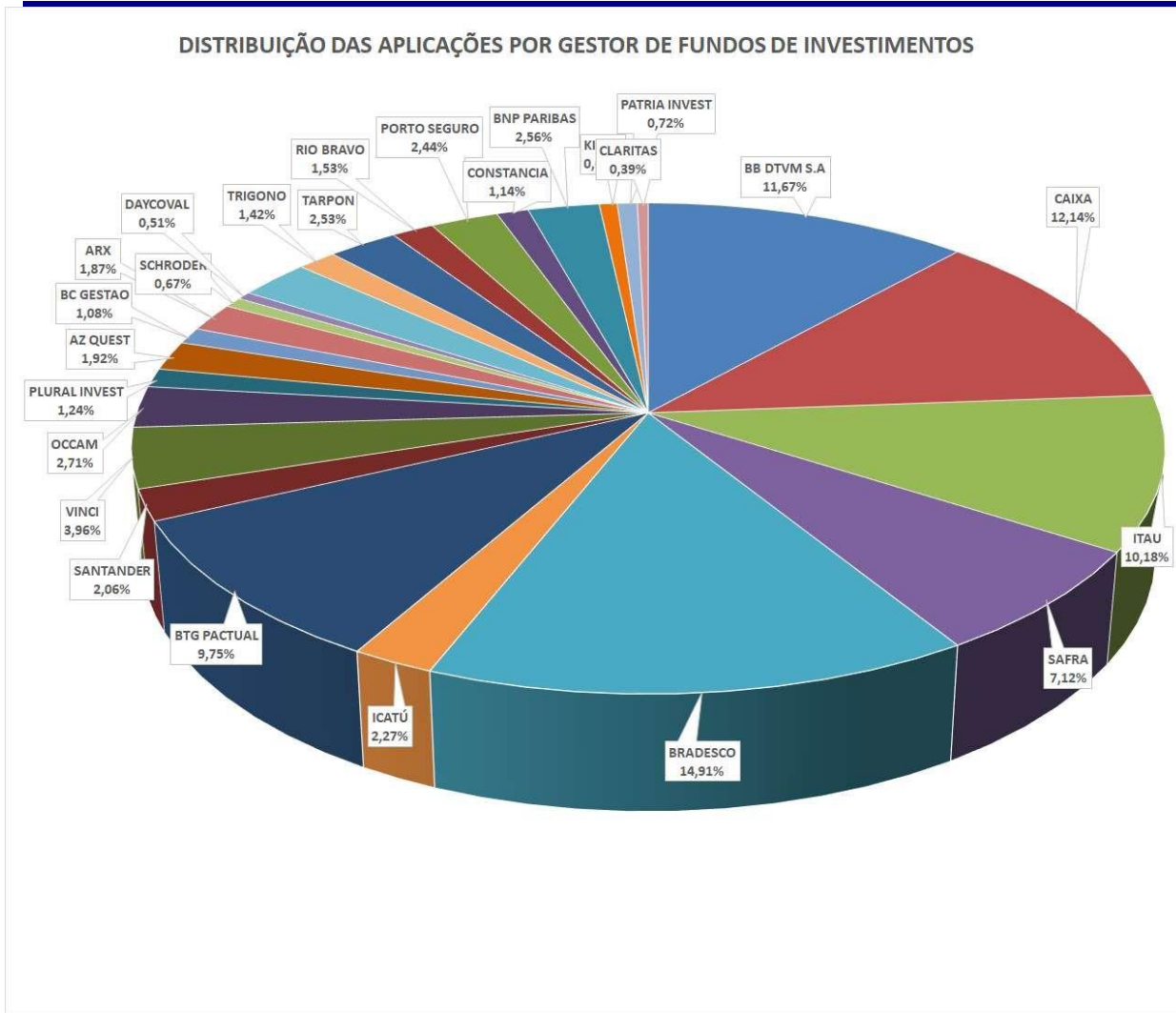


Gráfico 08

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
 Acesso: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDJyNTgo



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS – EXERCÍCIO 2023

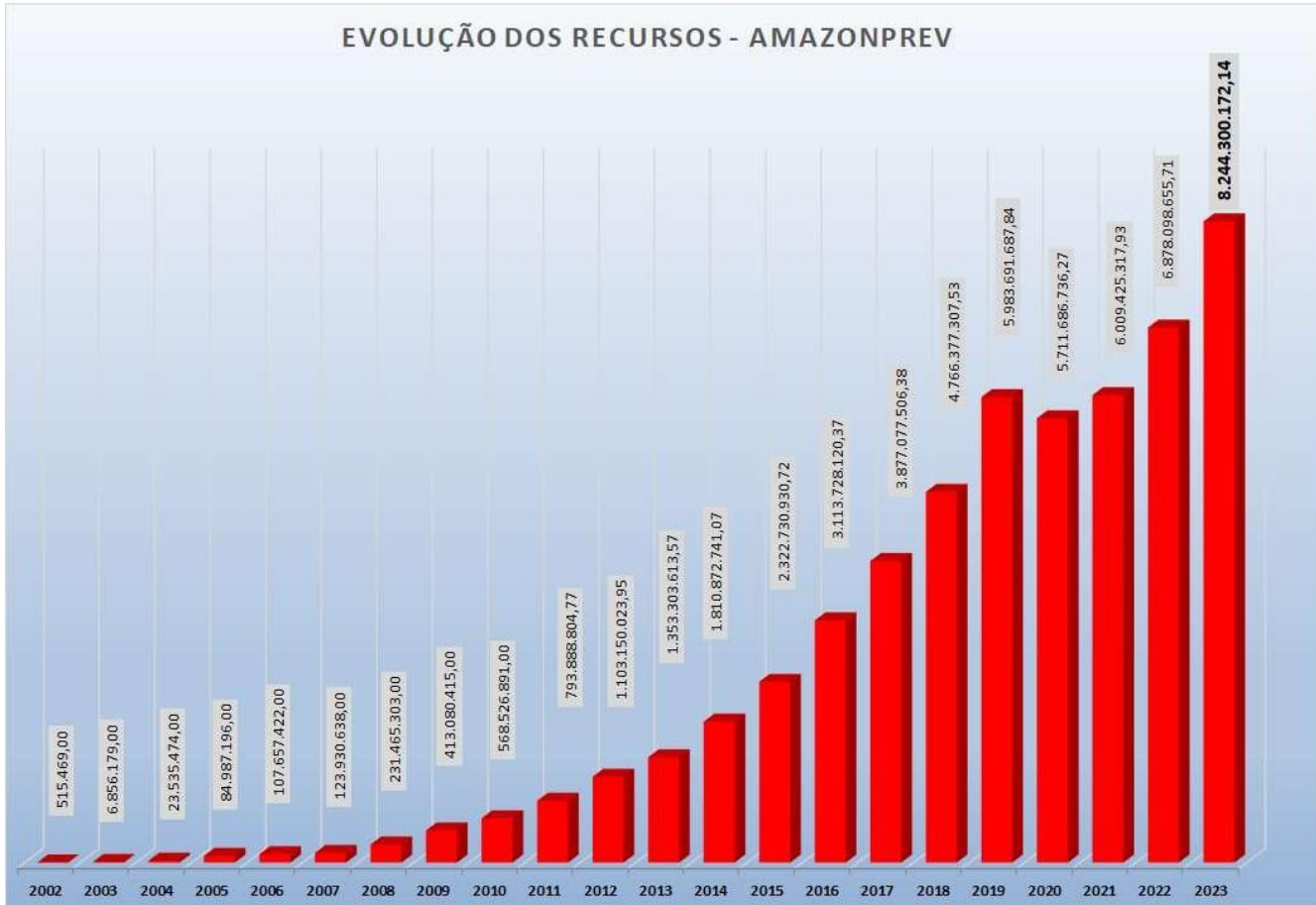


Gráfico 09

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 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: 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 AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDJyNTg0

