

1. INTRODUÇÃO

A Fundação Amazonprev apresenta o Plano de Aplicação e Investimentos para o exercício de 2023.

O Plano de Aplicações e Investimentos – PAI, ou Política de Investimentos, define a forma de gerenciamento dos investimentos e desinvestimentos dos recursos financeiros, cumprindo as normas e diretrizes referentes à gestão dos recursos financeiros do RPPS que se encontram previstos nos art. 4º e 5º da Resolução CMN Nº 4.963 de 25 de novembro de 2021, e art. 101 da Portaria MTP Nº 1.467, de 02 de junho de 2022.

Dentre as formas de gerenciamento, os princípios, metodologias e parâmetros estabelecidos nesta Política de Investimentos buscam garantir, contemplando do curto ao longuíssimo prazo, a segurança, liquidez e rentabilidades adequadas e suficientes ao equilíbrio entre ativos e passivos do plano previdenciário, levando em consideração os fatores de Risco, Segurança, Solvência, Liquidez e Transparência.

Adicionalmente, este documento trata da metodologia adotada para o apreamento dos ativos financeiros e gerenciamento de riscos, além dos princípios de responsabilidade socioambiental adotados, quando couber, podendo, inclusive, sofrer mudanças no decorrer do exercício, desde que, devidamente fundamentadas e submetidas à aprovação do órgão máximo de Deliberação da Fundação Amazonprev

Destaque na Política de Investimentos, os Limites de Alocação em ativos, descritos na legislação vigente, que buscam a superação da meta atuarial. E que também estabelece as vedações específicas que visam dotar os gestores de orientações quanto à alocação dos recursos financeiros em produtos e ativos adequados ao perfil e às necessidades atuariais da Amazonprev, por isso é de interesse dos servidores efetivos, aposentados, pensionistas, do Governo do Estado através dos seus representantes nos Conselhos de Administração e Fiscal, e da sociedade em geral, para que possam ter, através deste documento, os esclarecimentos necessários sobre a destinação dos recursos provenientes das contribuições previdenciárias, bem como as estratégias de alocação com o objetivo de obter os melhores resultados financeiros para esses recursos no próximo exercício.



Importante salientar que o Total da Carteira de Investimentos da Amazonprev é composto pelas contribuições previdenciárias dos servidores do Poder Executivo, Defensoria Pública – DPE/AM, pelo Legislativo (ALE e TCE), Poder Judiciário (TJ/AM) e Ministério Público do Estado do Amazonas (MPE/AM). Apesar dos controles gerenciais e acompanhamento dos recursos e aplicações, recebidos por esses órgãos, se realizarem de forma segregada, as informações prestadas à Secretaria de Previdência – SPPS/ME sempre estarão consolidadas, portanto, as Estratégias de Alocação e o acompanhamento dos Limites à Resolução CMN 4.963/2021 não distinguem a origem dos recursos.

Por fim, o Comitê de Investimentos, através do Conselho Diretor, submete ao Conselho Fiscal e Conselho de Administração, o Plano de Aplicações e Investimentos – PAI 2023, cujo conteúdo será apresentado ao Ministério da Economia por meio do Demonstrativo da Política de Investimentos – DPIN, conforme art. 1º da Portaria MPS nº 519/2001, art. 22 da Portaria MPS nº 402/2008 e art. 50, XVI, “g” da Portaria MPS nº 204/2008, solicitando análise e aprovação nos termos do artigo 69, I, alínea “e” c/c art. 78, I, alínea “i” da Lei Complementar nº 30/2001, texto consolidado em 29/07/2014.

**GABINETE DA DIRETORIA E COMITÊ DE INVESTIMENTOS DA FUNDAÇÃO
AMAZONPREV. Manaus, 16 de novembro de 2022.**

MARIA NEBLINA MARAES
Diretora-Presidente

4



2. DIRETRIZES

São aspectos a serem observados no processo de análise dos investimentos, desinvestimentos e gestão dos ativos:

- Aderência às normas gerais e específicas, onde o processo de análise deve cumprir as normas estabelecidas pela legislação vigente, bem como às resoluções e normas que regem os RPPS, além dos normativos internos da Amazonprev, tais como: Credenciamento de Instituições e Produtos de Investimentos,
- Aderência relativa aos aspectos à Governança, respeitando a estrutura de gestão e as competências, atribuições e responsabilidades dos agentes responsáveis pelos Investimentos: Comitê de Investimentos, Diretor de administração e Finanças, Diretor Presidente, Conselho Fiscal e Conselho de Administração;
- Acompanhamento sistemático da evolução do Cenário macroeconômico e financeiro, a fim de embasar as sugestões de investimentos, bem como justificar os resultados da Carteira de acordo com o perfil mais adequado para o RPPS;
- Garantia de que a atuação dos agentes que participam do processo de análise, avaliação, gerenciamento, assessoramento e decisão sobre as aplicações dos recursos deve cumprir integralmente o código de ética e de padrões de conduta profissional adotado pela Amazonprev;
- Aderência dos resultados compatíveis com as variações dos índices de mercado, de forma a garantir a compatibilidade com a meta atuarial, definida a partir da Parecer Atuarial 2022, proporcional ao nível de risco esperado para a Carteira. Nesse caso, registra-se: Para a avaliação atuarial, serão adotadas todas as novas definições da Portaria SPREV Nº 1.837/2022, que divulga a taxa de juros parâmetro a ser utilizada nas avaliações atuariais dos RPPS relativas ao exercício de 2023, posicionadas em 31 de dezembro de 2022.

Na avaliação atuarial, o cálculo da duração do passivo demonstra o tempo médio necessário para o plano pagar seu passivo. Desta forma se estabelece um parâmetro de idade para o plano, quanto maior a duração do passivo, mais jovem é o plano.



A tabela de juros da Portaria SPREV N° 1.837/2022 relaciona o tempo de duração do plano, com uma média de retorno ou rentabilidade dos títulos públicos para cada período de tempo. Ou seja, para a duração de 24,31 anos do RPPS, o retorno médio dos títulos públicos com este prazo seria de 4,82% ao ano. Assim, esta taxa deverá ser adotada para a meta de retorno esperado na Política de Investimentos em 2023, **IPCA + 4,82% a.a.** Este percentual será recalculado anualmente e, provavelmente, a tabela da taxa de juros de parâmetro será atualizada anualmente pela Secretaria de Previdência.

Para o cumprimento do retorno esperado, os responsáveis pelo Investimento dos recursos da Amazonprev, com acompanhamento do Conselho Fiscal e do Conselho de Administração, baseados nos Relatórios periódicos de análise dos produtos, poderão tomar as melhores decisões a respeito das alocações, observando o cumprimento integral aos termos legais respeitando os princípios da ética e da transparência.

3. OBJETIVOS

A Política traça como imprescindíveis para sua fiel aplicação os objetivos macro descritos abaixo:

- 3.1 Manter os recursos alocados em Fundos de Investimentos, cujas instituições financeiras tenham cumprido todos os critérios de Credenciamento estabelecido pela AMAZONPREV, e emanadas da Secretaria da Previdência e demais regulamentos inerentes à Política de Investimento, de forma a ficar garantida a capacidade técnica e o desempenho positivo de qualquer instituição contratada para prestação de serviços relacionados às aplicações dos recursos do RPPS;
- 3.2 Resguardar os recursos que compõem o patrimônio dos fundos, de forma que estes não sejam desvirtuados de sua finalidade, nem contrariem o que preconiza a legislação que rege os RPPS e esta Política de Investimentos;
- 3.3 Manter a transparência na gestão dos recursos, tendo o segurado como público-alvo principal das informações sobre a política de investimentos;
- 3.4 Garantir que os membros do Comitê e demais envolvidos na Gestão dos Investimentos se mantenham capacitados e certificados, visando ao êxito dessa Política e às boas práticas de gestão;



- 3.5 Tratar com celeridade e eficiência as movimentações financeiras, no que se refere às aplicações e resgates;
- 3.6 Manter à disposição dos órgãos de supervisão os documentos comprobatórios da execução da política de investimentos, bem como os oriundos de cumprimento de obrigações junto à Secretaria da Previdência Social;
- 3.7 Zelar pela integridade e imparcialidade dos membros do Comitê de Investimentos, na condução das operações de investimentos e desinvestimentos, com elevado padrão ético e eficiência dos procedimentos técnicos, operacionais e de controle das aplicações;
- 3.8 Definir parâmetros do Programa de Educação Financeira, priorizando às áreas envolvidas treinamentos sobre o mercado financeiro e cursos preparatórios para a certificação dos RPPS.

4. GESTÃO DE INVESTIMENTO

4.1 Modelo de Gestão

Para o exercício de 2023, a Amazonprev manterá a Gestão Própria dos investimentos, executando diretamente a Política de Investimentos e decidindo sobre as alocações dos recursos.

Participam do processo de decisão o Comitê de Investimentos, como órgão de assessoramento no processo decisório, a Diretoria de Administração e Finanças e Presidência (DIRAF e PRESI), com o dever de analisar e decidir sobre as sugestões apresentadas pelo Comitê. Cabendo aos conselhos de Administração e Fiscal a aprovação do Plano de Aplicações e Investimentos, além de acompanhar e fiscalizar a execução do Plano, participando, quando necessário, do processo de desinvestimentos, conforme a Política de Alçadas para o RPPS.

Como subsídio à gestão, a Amazonprev contará com a parceria da empresa LDB Consultoria, para apoio a relatórios operacionais, gerenciais, perfil de risco e outros, com capacidade para emissão dos Relatórios exigidos para o Nível IV do Pró Gestão. Ainda, a aquisição do sistema Estádio Broadcast possibilitará o acompanhamento, em tempo real, de notícias relevantes ao mercado financeiro e que impactam na volatilidade dos ativos.

4.2 Comitê de Investimentos

Embasado nas Portarias MPS n.ºs. 519/11, 170/12 e 440/13, Portaria MPT 1.467/2022 e Regimento Interno da Fundação, o Comitê de Investimentos é formado por membros vinculados ao RPPS,

7



formalmente designados e tecnicamente certificados, permitindo que o Comitê seja responsável por zelar pela implementação da Política de Investimento e participar do processo decisório na execução dessa política, cabendo ao Coordenador do Comitê a responsabilidade pela gestão das aplicações dos recursos junto à SPPS.

O Comitê de Investimentos tem a responsabilidade de realizar o acompanhamento sistemático da execução da Política, colaborando com a Diretoria quanto às estratégias de alocação dos recursos, com base na análise do Cenário Econômico de forma a aproveitar oportunidades de investimentos, bem como mitigar riscos para a carteira.

O Manual de Procedimentos de Investimentos – MPR17 define os requisitos e critérios para definir os membros do Comitê, além dos procedimentos a serem adotados pelos seus membros, referente ao processo de investimentos ou desinvestimentos dos recursos do RPPS.

Devido à complexidade da atividade relacionada aos investimentos e da responsabilidade inerente a função, todos os membros do Comitê de Investimentos devem possuir Certificação mínima adequada ao Nível IV do Pró Gestão.

4.3 Política de Limites de Alçada e Competência para os investimentos

O Limite de Alçadas é mais um instrumento de gestão dos recursos financeiros, norteador de limites necessários para a imediata tomada de decisão pelo Comitê de investimentos, além de definir as responsabilidades, fixando os limites para as aprovações relacionadas às tomadas de decisões que envolvam recursos da Amazonprev incluindo a taxa de administração.

A definição das atribuições e a separação de responsabilidades está prevista no § 2º do art. 86 da Portaria MTP 1.467/2022 e abrange as atribuições e as responsabilidades dos dirigentes, do Conselho de Administração, do Conselho Fiscal e do Comitê de Investimentos, no que se refere às aplicações dos recursos do RPPS.

Aprovada pela Diretoria em 30/09/2019, com base no Parecer COMIV/GETECI nº. 1987/2019, O Manual de Política de Alçadas no Processo de Investimentos, define como limites no item 2.2 Tabela de valores/limites de alçada para autorização de Investimentos e Desinvestimentos:



Natureza da Transação e Valor	GERAF/COFIN	COMIV	DIRAF/PRESI (CONJUNTO)	CONAD
Movimentação Estratégica - Investimentos e Desinvestimentos		Até R\$ 100.000.000,00 (cem milhões de reais)	Até R\$ 200.000.000,00 (duzentos milhões de reais)	Acima de R\$ 200.000.000,00 (duzentos milhões de reais)
Movimentações Operacionais – Baixa de Aplicação (Pagamentos de Custeio Administrativo)	Até R\$ 100.000,00 (cem mil reais)		De R\$ 100.000,00 (cem mil reais) até R\$ 5.000.000,00 (cinco milhões de reais)	Acima de R\$ 5.000.000,00 (cinco milhões de reais)
Movimentações Operacionais – Baixa de Aplicação (Folhas de Pagamento aposentados e pensionistas)	Até R\$ 150.000.000,00 (cento e cinquenta milhões de reais)		Acima de R\$ 150.000.000,00 (cento e cinquenta milhões de reais)	

O detalhamento do processo, com a definição dos critérios para aplicação da Alçada de cada um desses agentes encontra-se no Manual de Procedimentos de Investimentos – MPR17, da Amazonprev.

4.5 Credenciamento de Instituição Financeira

Os critérios para credenciamento de instituições financeiras estão disponíveis no endereço eletrônico: www.amazonprev.am.gov.br. O objetivo desse processo é estabelecer requisitos para salvaguardar os recursos das contribuições dos servidores, buscando avaliar aspectos das instituições, como: solidez patrimonial, rating de governança, experiência na gestão de fundos para RPPS, histórico de investimentos, dentre outros.

5. CONJUNTURA ECONÔMICA: CENÁRIO

A expectativa de retorno dos investimentos passa pela definição de um cenário macroeconômico, que deve levar em consideração as possíveis variações que os principais indicadores podem sofrer.





A meta de rentabilidade da Fundação é indexada ao IPCA, assim, a atenção do Comitê volta-se para à curva de juros em busca da rentabilidade necessária. As pesquisas de mercado consolidadas no boletim Focus, divulgada pelo Banco Central, mostra o fim do aumento da taxa de juros ao nível de 13,75%, denotando o fim do ciclo de aperto monetário no Brasil, distanciando da atual conjuntura global, e reduzindo-se gradualmente até 11,25% ao final do ano de 2023. As perspectivas do PIB para o ano futuro continuam céleres para uma taxa de 0,70% de crescimento, com uma inflação de 4,94%.

A inflação mesmo em queda deve ser monitorada continuamente, pois choques exógenos ao Brasil ainda são prováveis, além de possíveis ajustes na política econômica do futuro governo, podem alterar a dinâmica imposta atualmente e acelerar os núcleos de monitoramento da inflação.

No cenário de geração de emprego o Brasil passa por um momento único, que mesmo com o aperto monetário estrondoso, a perspectiva da taxa de desemprego no final de 2022 é de 8.3%, a menor nos últimos 7 anos.

Os dados de arrecadação continuam a sinalizar um forte resultado, principalmente das empresas. Será registrado superávit em 2022, com possibilidade de acomodações nas receitas em 2023 dada a desaceleração da economia doméstica e global.

Focus | MEDIANAS DAS EXPECTATIVAS DE MERCADO

4 de novembro de 2022

	2022				2023				2024		2025	
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal*	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal*	Hoje	Comp. semanal*	Hoje	Comp. semanal*
IPCA (%)	5,71	5,61	5,63	▲ (2)	5,00	4,94	4,94	= (2)	3,50	= (2)	3,00	= (89)
PIB (var. %)	2,70	2,76	2,76	= (2)	0,54	0,64	0,70	▲ (6)	1,80	= (2)	2,00	= (52)
CÂMBIO (R\$/US\$)	5,20	5,20	5,20	= (15)	5,20	5,20	5,20	= (15)	5,10	= (1)	5,18	▲ (1)
SELIC (% a.a.)	13,75	13,75	13,75	= (20)	11,25	11,25	11,25	= (9)	8,00	= (17)	8,00	▲ (1)

* comportamento dos indicadores desde o último Focus; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento.

▲ Aumento ▼ Diminuição = Estabilidade
em relação ao Focus anterior

10

Av. Visconde de Porto Alegre, 486, Centro
Fone: (92)3627-3424
Manaus-AM-CEP 69010-125

AMAZONPREV
Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



O cenário externo galga grandes desafios no ano vindouro devido o ciclo monetário de ajuste com aumento dos juros pelo FED, problemas de abastecimento de combustíveis e desaceleração da economia mundial, além da guerra Ucrânia. A economia Norte Americana já passa por uma recessão econômica, contudo com viés de retomada e crescimento já no 4º trimestre de 2023, mitigando possíveis ajustes maiores ao cenário atual. A China enfrenta problemas de depreciação cambial relevantes devido à desaceleração econômica e inflação, destoando o boom de commodities ocorrida no final de 2021 e início de 2022.

Por fim, o mercado interno ainda tenta absorver os resultados de eleições majoritárias. Após o fim do 2º turno, o candidato eleito poderá encontrar certa dificuldade para montar uma base no Congresso, visto que a maioria de Deputados e Senadores eleitos representam partidos de centro-direita, e podem se manifestar como oposição ao novo Governo.

Além da governabilidade, o próximo presidente vai se deparar com uma economia operando com inflação alta, apesar do alívio trazido pela desoneração tributária e da redução de demanda global por determinadas commodities internacionais. E como já está anunciado, será necessário um gasto extra teto, que poderá chegar ao Congresso através de uma PEC, com possibilidade de gastos próximos a R\$ 200 bilhões, minando a credibilidade do novo governo com o controle dos gastos públicos.

Então, como já é tradição, o país continuará em um novo exercício passando por mais um ciclo de incertezas, com intensa volatilidade e riscos, mas com oportunidades no mercado financeiro.

6. ESTRATÉGIAS E LIMITES PARA ALOCAÇÃO DE RECURSOS

Na gestão dos recursos serão adotados critérios para os investimentos e desinvestimentos. Embora o RPPS deva buscar investimentos no longo prazo, poderão ser realizadas movimentações que tenham o objetivo de obter retorno financeiro de curto prazo, procurando distorções de preços em excessos de valorização ou desvalorização dos ativos financeiros, ou ainda, movimentos que sejam mais adequados ao contexto operacional do fluxo da folha de pagamentos de inativos e pensionistas no curtíssimo prazo.



No cumprimento dos preceitos estabelecidos nos segmentos de RENDA FIXA e/ou RENDA VARIÁVEL, deverão ser observadas as seguintes regras:

- No processo de investimento, entende-se por Novas Alocações as aplicações realizadas em fundos que não compuserem a carteira do RPPS ou decorrentes do pagamento de juros de cupom de Títulos;
- O processo de desinvestimento poderá ocorrer quando a cota do fundo for superior à cota de aplicação, ou na ocorrência de mudança de cenário econômico, que impactam em eventuais perdas;
- Os fundos com evolução de cotas em um período inferior a 36 (trinta e seis) meses não poderão receber recursos, salvo quando se tratar de: Fundo de Investimentos em Cotas (FIC) ou Feeders cujo fundo máster registre evolução de cotas superior a esse período, além de Fundos de Investimentos em Participação (FIP);
- No processo de seleção de fundos de investimentos, que tenham a mesma classificação de ativo e mesmo benchmark, poderá ser utilizado como critério de escolha o valor cobrado de taxa de administração do fundo de investimentos, bem como índice de Sharp e VAR;
- As regras de investimentos e desinvestimentos poderão ser flexibilizadas nos seguintes casos: quando houver poucos produtos semelhantes entre as instituições credenciadas junto ao RPPS; quando os recursos forem caracterizados como de curto prazo; quando os recursos forem referentes ao custeio administrativo ou pagamento de benefícios previdenciários;
- Não serão permitidas a realização de investimentos sem o Parecer favorável do Comitê de Investimentos com aprovação da Diretoria de Administração e Finanças e do Diretor Presidente da Amazonprev;

Ainda, independente da estratégia de retorno da aplicação, serão permitidas operações de investimentos e desinvestimentos para os casos que exijam o cumprimento dos limites estabelecidos na Legislação Vigente, com base no Limite de Alçadas de Investimentos.



6.1 SEGMENTO RENDA FIXA

6.1.1 Títulos do Tesouro Nacional: Projeta-se uma queda da taxa Selic para 11,25% em 2023. Nesse Cenário, com quadro inflacionário estável, taxa Selic com tendência de redução, já a partir do segundo semestre de 2023, a expectativa é de que as taxas dos títulos públicos, no mercado futuro, cheguem a um ponto de estabilidade, reduzindo os ganhos de valorização. Assim, não serão programadas novas aquisições de TPF, de forma que em 2023 ocorra redução natural do percentual desses ativos, devido ao pagamento semestral de cupom de juros e o aumento do total de recursos da Amazonprev com novos repasses de arrecadação. Claudinei

Porém, num cenário macro adverso, é possível que a taxa de juros permaneça em um patamar elevado por mais tempo. Dessa feita, há possibilidade, nessas condições, para a manutenção ou aumento na posição desses ativos, desde que cumpridos os ritos operacionais definidos pelo Comitê de Investimentos.

6.1.2 Fundos de Investimentos 100% TPF: O Mercado Financeiro espera um cenário com menor pressão inflacionaria para 2023 ao mesmo tempo que projeta menor crescimento econômico para o país, nesse caso a redução das taxas de juros é considerada como fator essencial para estimular o PIB com menor risco de alta inflacionária. Portanto, nessas condições, é natural o aumento de posição nesses ativos, onde a maior concentração será em fundos com *duration* de médio prazo, até 5 anos, pois abre-se oportunidade de alocação nesses segmentos e captura da redução das taxas vindouras no decorrer de 2023. Ainda, com a previsibilidade de redução da taxa de juros e menor inflação os fundos de Títulos pré fixados também estarão no radar para compor a carteira da Amazonprev.

6.1.3 Operações Compromissadas: As Operações Compromissadas são realizadas, na maioria das vezes, para complementação de caixa em uma instituição financeira, ou seja, quando a instituição precisa de recursos financeiros. No entanto, a Amazonprev poderá se utilizar dessa operação pela necessidade de manter os recursos aplicados, principalmente, no último dia útil do mês, evitando que os recursos fiquem sem aplicação em conta corrente.



6.1.4 Fundos Renda Fixa/Referenciado: O cenário atual, marcado pelo arrefecimento da inflação e redução da taxa de juros, os ativos Referenciados tornam-se opções interessantes para o Rentabilidade da carteira de investimentos além de manter a diversificação e diminuir os riscos de mercado;

6.1.5 Fundos Renda Fixa/Referenciado – IMA/IDKA: cenário atual, marcado pelo arrefecimento da inflação e redução da taxa de juros, os ativos Referenciados tornam-se opções interessantes para o Rentabilidade da carteira de investimentos além de manter a diversificação e diminuir os riscos de mercado;

6.1.6 Fundos Renda Fixa (Normal): Os fundos com Gestão Ativa se mostram, nesse Cenário de maior volatilidade, como ótima opção de investimento, portanto, ficando justificado o aumento de posição nesses fundos, pois a estratégia desses produtos buscará superar o CDI no longo prazo.

6.1.7 Poupança / Letras Imobiliárias: Esses ativos não estão contemplados na Política, pois os retornos, no Cenário esperado, ficarão abaixo dos demais produtos nesse segmento.

6.1.8 FIDC e Fundo Crédito Privado: Com a expectativa de retomada do Crescimento econômico, e consequente melhora dos créditos tomados no mercado, os Fundos de Crédito Privado poderão ter mais visibilidade. Ainda, por se tratar de produtos com pouco mais de risco, a rentabilidade é melhor do que os fundos classificados como Renda Fixa. Somente serão alocados recursos nesses ativos, após análise e Parecer favorável da equipe técnica, e estará condicionada à oferta de produtos que preencham os seguintes requisitos: O fundo deverá apresentar em sua carteira direitos, títulos e valores mobiliários e/ou os respectivos emissores sejam considerados de baixo risco de crédito, com base, dentre outros critérios, em classificação efetuada por agência classificadora de risco em funcionamento no País e oferecer retornos superiores a Meta Atuarial dos RPPS, ou seja, IPCA + 4,82%. Ainda, com a possibilidade de marcação na curva de ativos de crédito privado, regulamentada pelo Ministério da Previdência, abre-se um novo leque de oportunidades de investimentos em Renda Fixa, através de Letras Financeiras de grandes instituições bancárias no



Brasil. O retorno esperado é sempre superior aos títulos públicos com destaque as LF indexadas ao IPCA, similares aos Títulos Públicos NTN-B com juros semestrais, que a depender do seu vencimento, o investidor poderá obter de 1% a 2% de spread de ganho real. Vale ressaltar que a aquisição de Letras Financeiras só deverão ocorrer se o emissor do ativo seja classificada por agência de Rating como Baixo Risco de Crédito e classificada como segmento S1 pelo Banco Central, em Letras Financeiras Sênior, com vencimento de no máximo 5 anos. Essas classificações visam mitigar risco de crédito advindos dos tomadores de crédito.

6.2 SEGMENTO RENDA VARIÁVEL

Para essa modalidade de investimento, com base no Cenário traçado pelos especialistas de mercado com possibilidade de retomada significativa do Crescimento econômico do país, e em movimento pós pandemia, a estratégia é alocar até o limite máximo (45% - Nível III Pró Gestão) dos recursos em moeda corrente do RPPS, conforme determinado na Estratégia de Alocação, com preferência aos Fundos de Investimentos em Ações Geral (art. 8º, II-a).

- Para os Fundos de Ações, as estratégias de investimentos e desinvestimentos estarão condicionadas às análises prévias dos fundos, da equipe de gestores dos fundos, além dos resultados Históricos desses fundos, e comparados aos demais ativos de mesma estratégia de Gestão nas demais instituições financeiras, considerando ainda o cenário econômico no momento da tomada de decisão.

O Comitê de Investimentos entende que manter a Estratégia de alocar recursos em Fundos de Ações é salutar, visto que são investimentos de Longo Prazo e, portanto, alinhados com a filosofia dos RPPS. Além disso, o Cenário de redução de juros aliado à volatilidade do mercado esperado para os próximos meses, podem ocasionar ganhos expressivos para o segmento. Vale ressaltar que bolsa Brasileira veem se desprendendo do exterior e gerando resultado positivos para os seus acionistas.

- Para fundos Multimercados, as novas aplicações deverão observar a performance mínima em doze meses buscará ser igual ou superior a 101% do benchmark. Sendo possível o **Desinvestimento** quando rentabilidade em doze meses for abaixo do benchmark por três meses consecutivos, podendo ter sua posição reduzida em até 50%. Se a rentabilidade em doze



meses persistir abaixo do benchmark por cinco meses consecutivos, todo o recurso poderá ser resgatado. No entanto, com o objetivo de diminuir ao máximo a correlação com os índices do mercado interno, o Comitê de Investimentos vê como melhor opção, para esse artigo, direcionar os recursos para os fundos indexados ao S&P 500 (mercado americano);

- Fundos de Participação (FIP) e Fundos Imobiliários (FII), com a expectativa de retomada da economia no período pós pandemia, e consequente melhora das expectativas no mercado, os Fundos de Participação (FIP) e Fundos Imobiliários (FII) mantêm-se como boas opções de investimentos, principalmente para a diversificação da Carteira. Ainda, por se tratar de produtos com maior nível de risco de Crédito, a rentabilidade deverá ser melhor do que os fundos classificados como Renda Fixa Crédito Privado. Portanto, somente serão alocados recursos nesses ativos após análise minuciosa do produto apresentado, com emissão de Parecer favorável da equipe técnica, e estará condicionada à oferta de produtos que preencham esses requisitos.

6.3 FUNDOS ETFS (EXCHANGE TRADED FUNDS): Os ETFs são fundos atrelados a um índice de referência, ou seja, o gestor do fundo fica obrigado a ajustar a composição do fundo de modo que a sua carteira seja a mais parecida possível com a do indicador (IMA, CDI, IRF-M ou Ibovespa, por exemplo). Portanto, dada a necessidade de manter o portfólio da Amazonprev com a máxima diversificação, para o exercício de 2022, num cenário de incertezas, o Comitê poderá realizar operações com esses ativos, com o objetivo de mitigar os riscos de mercado.

6.4 INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

A alocação de recursos em fundos de Investimentos no exterior tem a finalidade de aumentar a diversificação da carteira, com possibilidade de melhor desempenho no Longo Prazo, dada à expressividade dos mercados americano e europeu, principalmente. Serão permitidos alocação nos fundos cujos gestores estejam em atividade há mais de 05 (cinco) anos e administrem montante de recursos de terceiros superior a US\$ 5 bilhões, e com histórico de fundo com performance superior a 12 (doze) meses.



6.5 SEGMENTO DE CREDITO CONSIGNADO

A Resolução CMN nº. 4.963/21, no art. 12, a opção de aplicação de recursos no segmento de Empréstimos Consignados aos servidores em atividade, aposentados e pensionista, na modalidade de consignados, onde os parâmetros de rentabilidade perseguidos para a carteira de empréstimos consignados deverão buscar compatibilidade com o perfil das obrigações do RPPS, tendo em vista a necessidade de busca e manutenção do equilíbrio financeiro e atuarial.

Dada a estrutura necessária, a partir das orientações reguadas pela Portaria 1.467/2022, somadas às condições de Cenário Econômico, com taxa de juros acima de 13%, o Comitê não vê como oportuno a aplicação nesse segmento, por ora. Observa-se que a relação custo/benefício inviabiliza, nesse momento, esse tipo de aplicação, lembrando que no mercado financeiro os fundos indexados ao CDI, no segmento de Renda Fixa, devem apresentar retorno acima da meta atuarial no próximo exercício, já considerando a inflação projetada para 2023.

A Amazonprev poderá realizar aplicações nesse segmento após Parecer favorável dos Conselhos Fiscal e de Administração, com base em estudo técnico que comprove melhor relação de custo benefício e cumprindo todas as orientações emanadas da SPPS.

6.6 DEFINIÇÃO DAS ESTRATÉGIAS DE ALOCAÇÃO DOS RECURSOS

Em atenção aos limites definidos na Resolução CMN nº 4.963/2021, é apresentada Estratégia de Alocação de Recurso da Política de Investimentos - 2023, onde é considerada a expectativa de retorno a partir das análises do mercado financeiro.

Nesse caso, cumprindo-se o Cenário projetado, convém informar que os resultados esperados se aproximam da meta atuarial projetada (IPCA + 4,82%) para o próximo exercício, conforme resumo:

Descrição	até outubro/2022	2022 Projetado	2023 Projetado
Total de Recursos	R\$ 6.500.696.442,13	R\$ 7.079.832.651,09	R\$ 8.460.768.695,49
Meta Atuarial	7,93%	10,94%	10,06%
Rentabilidade	2,26%	5,80%	16,08%
* Taxa Selic	13,75%	13,75%	11,25%

* Projeção pelo Relatório FOCUS



ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO DE RECURSOS - PAI 2023

TIPO DE ATIVO	Artigo da Resolução 4.693/2021	LIMITE DA RESOLUÇÃO CMN (%)	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - POLÍTICA DE INVESTIMENTOS DE 2023		
			LIMITE INFERIOR (%)	ESTRATÉGIA ALVO (%)	SUPERIOR (%)
RENDA FIXA					
Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	Art. 7º, I,"a"		-	34,00	100,00
Fundos Renda fixa 100% TP/ETF	Art. 7º, I,"b"	100,00	0,00	28,00	100,00
Fundos Renda Fixa "Livre"	Art. 7º, I,"c"		-	-	-
Operações compromissadas com lastros em TPF	Art. 7º, II	10,00	-	1,00	1,00
Renda fixa conforme CVM	Art. 7º, III,"a"	70,00	-	5,00	70,00
ETF RF CVM	Art. 7º, III,"b"		-	-	-
Ativos financeiros de renda fixa de emissão com obrigação ou coobrigação de instituições financeiras (Lista BACEN)	Art. 7º, IV	30,00	-	1,00	5,00
FIDC Sênior	Art. 7º, V,"a"		-	-	1,00
Renda Fixa Crédito Privado	Art. 7º, V,"b"	10,00	-	10,00	10,00
Debentures Incentivadas	Art. 7º, V,"c"		-	-	1,00
RENDA VARIÁVEL	Artigo da Resolução 4.693/2021	LIMITE DA RESOLUÇÃO CMN (%)	LIMITE INFERIOR (%)	ESTRATÉGIA ALVO (%)	LIMITE SUPERIOR (%)
Fundo de Ações CVM	Art. 8º, I,"a"	45,00	0,00	15,00	44,00
ETF RV CVM	Art. 8º, I,"b"		-	-	1,00
EXTERIOR	Artigo da Resolução 4.693/2021	LIMITE DA RESOLUÇÃO CMN (%)	LIMITE INFERIOR (%)	ESTRATÉGIA ALVO (%)	LIMITE SUPERIOR (%)
FIC e FIC FI- Renda Fixa - Dívida Externa	Art. 9º, I		-	-	-
FIC Aberto - Investimento no Exterior	Art. 9º, II	10,00	-	1,00	5,00
Fundo de Ações – BDR Nível I	Art. 9º, III		-	1,00	5,00
FUNDOS ESTRUTURADOS	Artigo da Resolução 4.693/2021	LIMITE DA RESOLUÇÃO CMN (%)	LIMITE INFERIOR (%)	ESTRATÉGIA ALVO (%)	LIMITE SUPERIOR (%)
Fundos Multimercados	Art. 10, I,"a"	10,00	1,00	2,00	10,00
FI em Participações	Art. 10, I,"b"	5,00	-	2,00	5,00
FI Ações - Mercado de Acesso	Art. 10, I,"c"	5,00	-	-	5,00
FUNDOS ESTRUTURADOS	Artigo da Resolução 4.693/2021	LIMITE DA RESOLUÇÃO CMN (%)	LIMITE INFERIOR (%)	ESTRATÉGIA ALVO (%)	LIMITE SUPERIOR (%)
FI Imobiliários	Art. 11	5,00	-	-	5,00
FUNDOS ESTRUTURADOS	Artigo da Resolução 4.693/2021	LIMITE DA RESOLUÇÃO CMN (%)	LIMITE INFERIOR (%)	ESTRATÉGIA ALVO (%)	LIMITE SUPERIOR (%)
EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS	Art. 12	10,00	-	-	-

Nota: Foi tomado como base o Relatório de Estudo ASSET LIABILITY MANAGEMENT (ALM) 2022, emitido pela LDM Empresas.





6.7 CVS e Imóveis

Os títulos CVS, que compõem a carteira da AMAZONPREV, estão custodiados pela CETIP e se encontram devidamente enquadrados no § 2º do art. 27º da Resolução CMN nº 4.963/2022.

Desde janeiro/2009, a AMAZONPREV vem recebendo o valor do principal desses títulos, consoante estabelece a Lei Federal nº. 10.050, de 21 de dezembro de 2000, que dispõe sobre a novação de dívidas e responsabilidades do Fundo de Compensação de Variações Salariais – FCVS. Os recursos provenientes do pagamento dos juros e do principal desses títulos CVS serão aplicados em Renda Fixa, respeitados os limites legalmente estabelecidos e as condições de mercado, e a estratégia de alocação definida nessa Política.

Os recursos provenientes de operações comerciais com imóveis (alienações e locações) seguirão a política de aplicações determinada para este segmento, ou seja, serão aplicados em Renda Fixa e ou Renda Variável, observando sempre os limites e os percentuais aprovados no PAI 2023.

7. BENCHMARKS POR SEGMENTO

Entende-se como índice de referência, ou *benchmark*, para determinado segmento de aplicação o índice que melhor reflete a rentabilidade esperada para o curto prazo, isto é, para horizontes mensais ou anuais, conforme as características do investimento. Esse índice está sujeito às variações momentâneas do mercado.

SEGMENTO	BENCHMARK
Renda Fixa	70% CDI/TPF (IMA)
Renda Variável	IBOVESPA
Investimentos no Exterior – IE	MSCI / S&P 500

8. GESTÃO DE RISCOS

Em linha com o que estabelece a Resolução CMN nº 4.963/2021, este tópico estabelece quais serão os critérios, parâmetros e limites de gestão de risco dos investimentos.





O objetivo deste capítulo é demonstrar a análise dos principais riscos destacando a importância de estabelecer regras que permitam identificar, avaliar, mensurar, controlar e monitorar os riscos aos quais os recursos do plano estão expostos, entre eles os riscos de mercado, de crédito, de liquidez, operacional, terceirização, legal e sistêmico.

O controle de alguns dos riscos poderá ser atribuído a terceiro contratado, o qual deve ser feito por meio de modelos que contemplem, no mínimo, os itens e parâmetros estabelecidos neste Plano.

8.1 Risco de Mercado

O acompanhamento do risco de mercado será feito através do *Value-at-Risk* (VaR), que estima, com base nos dados históricos de volatilidade dos ativos presentes na carteira analisada, a perda esperada.

Cabe apontar que os modelos de controle apresentados nos tópicos a seguir estão sujeitos a imprecisões típicas de modelos estatísticos frente a situações anormais de mercado.

8.1.1 VaR

Para o consolidado dos segmentos, o controle de risco de mercado será feito por meio do *Value-at-Risk* (VaR), com o objetivo de controlar a volatilidade da cota do plano de benefícios. Este será calculado com os seguintes parâmetros:

- Modelo: paramétrico.
- Intervalo de Confiança: 95%.
- Horizonte: 22 dias úteis.

O controle de riscos deve ser feito de acordo com os seguintes limites acima do índice:

SEGMENTO	LIMITE
RENDA FIXA	5%
RENDA VARIÁVEL	20%
INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	20%



8.1.2 Análise de Stress

A avaliação dos investimentos em análises de stress passa pela definição de cenários de stress, que podem considerar mudanças bruscas em variáveis importantes para o apreamento dos ativos, como taxas de juros e preços de determinados ativos.

Embora as projeções considerem as variações históricas dos indicadores, os cenários de stress não precisam apresentar relação com o passado, uma vez que buscam simular futuras variações adversas.

Para o monitoramento do valor de stress da carteira, serão utilizados os seguintes parâmetros:

- Cenário: BM&F;
- Periodicidade: mensal

O modelo adotado para as análises de stress é realizado por meio do cálculo do valor a mercado da carteira, considerando o cenário atípico de mercado e a estimativa de perda que isso pode gerar.

Cabe registrar que essas análises não são parametrizadas por limites, uma vez que a metodologia considerada pode apresentar variações que não implicam, necessariamente, em possibilidade de perda. O acompanhamento terá como finalidade avaliar o comportamento da carteira em cenários adversos para que os administradores possam, dessa forma, balancear melhor as exposições.

8.2 RISCO DE CRÉDITO

8.2.1 Abordagem Qualitativa

A Amazonprev utilizará para essa avaliação do risco os *ratings* atribuídos por agência classificadora de risco de crédito atuante no Brasil. Os ativos serão enquadrados em duas categorias:

- Grau de investimento: 75%
- Grau especulativo: 7,5%
- Total Crédito Privado: 75%

Para checagem do enquadramento, os títulos privados devem, a princípio, ser separados de acordo com suas características:





ATIVO	RATING EMISSOR	RATING EMISSÃO
Títulos emitidos por instituição não financeira	X	X
FIDC		X
Títulos emitidos por instituição financeira	X	

Os títulos emitidos por instituições não financeiras podem ser analisados pelo rating de emissão ou do emissor. No caso de apresentarem notas distintas entre estas duas classificações, será considerado, para fins de enquadramento, o pior *rating*.

Posteriormente, é preciso verificar se o papel possui *rating* por uma das agências elegíveis e se a nota é, de acordo com a escala da agência, igual ou superior à classificação mínima apresentada na tabela a seguir:

AGÊNCIA	FIDC	INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	INSTITUIÇÃO NÃO FINANCEIRA
PRAZO	-	Longo prazo	Longo prazo
Standard & Poors	brA-	brA-	brA-
Moody's	A3.br	A3.br	A3.br
Fitch Ratings	A-(bra)	A-(bra)	A-(bra)
SR Ratings	brA	brA	brA
Austin Rating	brAA	brAA	brAA

Os investimentos que possuírem *rating* igual ou superior às notas indicadas na tabela serão enquadrados na categoria grau de investimento, desde que observadas as seguintes condições:

- Os títulos que não possuem *rating* pelas agências elegíveis (ou que tenham classificação inferior às que constam na tabela) devem ser enquadrados na categoria grau especulativo;
- Caso duas agências elegíveis classifiquem o mesmo papel, será considerado, para fins de enquadramento, o pior *rating*;
- O enquadramento dos títulos será feito com base no *rating* vigente na data da verificação da aderência das aplicações à política de investimento.



8.3 Risco de Liquidez

O risco de liquidez pode ser dividido em duas classes:

- Possibilidade de indisponibilidade de recursos para pagamento de obrigações (Passivo);
- Possibilidade de redução da demanda de mercado (Ativo).

Os itens a seguir detalham as características destes riscos e a forma como eles serão geridos.

É importante registrar que os instrumentos de controle apresentados são baseados em modelos estatísticos que, por definição, estão sujeitos a desvios decorrentes de aproximações, ruídos de informações ou de condições anormais de mercado.

O Comitê de Investimentos deve acompanhar, de forma sistemática, a evolução do risco de liquidez das aplicações através de relatórios emitidos pelas instituições ou em visitas de Diligências para verificação de lastro dos ativos dos fundos.

8.3.1 Indisponibilidade Para Pagamento de Obrigações (Passivo)

A gestão do risco de indisponibilidade de recursos para pagamento de obrigações depende do planejamento estratégico dos investimentos, mas principalmente do cumprimento por parte do Ente Federativo dos repasses tempestivos e integrais dos valores que compõe as contribuições previdenciárias correntes, com base nas alíquotas de contribuição definidas em Lei. A aquisição de títulos ou valores mobiliários com prazo ou fluxos incompatíveis com as necessidades do plano pode gerar um descasamento.

A aplicação do Estudo ALM deve garantir o fluxo financeiro atuarial para o curto, médio e longo prazo.

8.3.2 Redução de Demanda de Mercado (Ativo)

A segunda classe de risco de liquidez pode ser entendida como a possibilidade de redução ou inexistência de demanda pelos títulos e valores mobiliários integrantes da carteira. Percentual da carteira que pode ser negociada em condições adversas.





O controle do risco de liquidez de demanda de mercado será feito por meio dos limites da tabela abaixo, onde será analisado o curto (de 0 a 30 dias), médio (de 30 dias a 365 dias) e longo prazo (acima de 365 dias). Esses valores deverão obedecer aos seguintes limites:

HORIZONTE	PERCENTUAL MÍNIMO DA CARTEIRA
De 0 a 30 dias	90%
De 31 dias a 365 dias	10%
Acima de 365 dias	0%

8.4 Risco Operacional

Como Risco Operacional é “a possibilidade de ocorrência de perdas resultantes de falha, deficiência ou inadequação de processos internos, pessoas e sistemas, ou de eventos externos”, a gestão será decorrente de ações que garantam a adoção de normas e procedimentos de controles internos, alinhados com a legislação aplicável.

Dentre os procedimentos de controle podem ser destacados:

- A definição de rotinas de acompanhamento e análise dos relatórios de monitoramento dos riscos descritos nos tópicos anteriores;
- O estabelecimento de procedimentos formais para tomada de decisão de investimentos;
- Acompanhamento da formação, desenvolvimento e certificação dos participantes do processo decisório de investimento; e
- Formalização e acompanhamento das atribuições e responsabilidade das todos os envolvidos no processo planejamento, execução e controle de investimento.

8.5 Risco de Terceirização

Na administração dos recursos financeiros há a possibilidade da terceirização total ou parcial dos investimentos da Instituição. Esse tipo de operação delega determinadas responsabilidades a





gestores externos, porém não isenta o RPPS de responder legalmente perante os órgãos fiscalizadores.

Neste contexto, o modelo de terceirização exige que a Instituição tenha um processo formalizado para escolha e acompanhamento de seus gestores externos.

Mesmo que a Instituição possua um modelo de gestão interna, o risco de terceirização está presente, pelo fato do processo operacional da gestão depender de alguns terceiros em determinadas etapas. Na execução das ordens de compra e venda é necessária a utilização de uma corretora de títulos e valores mobiliários e na precificação e guarda dos ativos é necessário um agente custodiante.

8.6 Risco Legal

O risco legal está relacionado a não conformidade com normativos internos e externos, podendo gerar perdas financeiras procedentes de autuações, processos judiciais ou eventuais questionamentos.

O controle dos riscos dessa natureza, que incidem sobre atividades e investimentos, será feito por meio:

- Da realização de relatórios de *compliance* que permitam verificar a aderência dos investimentos às diretrizes da legislação em vigor e à política de investimento, realizados periodicamente;
- Da utilização de pareceres jurídicos sobre contratos com terceiros, quando necessário.

8.7 Risco Sistêmico

O risco sistêmico se caracteriza pela possibilidade de que o sistema financeiro seria contaminado por eventos pontuais, como a falência de um banco ou de uma empresa. Apesar da dificuldade de gerenciamento deste risco, ele não deve ser relevado. É importante que ele seja considerado em cenários, premissas e hipóteses para análise e desenvolvimento de mecanismos de antecipação de ações aos eventos de risco.





Para tentar reduzir a suscetibilidade dos investimentos a esse risco, a alocação dos recursos deve levar em consideração os aspectos referentes à diversificação de setores e emissores, bem como a diversificação de gestores externos de investimento, visando a mitigar a possibilidade de inoperância desses prestadores de serviço em um evento de crise.

8.8 Risco de Concentração de Recursos

A concentração de recursos em um mesmo fundo de investimentos com baixa diversificação, em uma mesma instituição financeira, ou de concentração da Carteira em Valores Mobiliários de um mesmo emissor pode acarretar no aumento do risco de liquidez e de crédito na carteira, afetando negativamente a cotação dos ativos da carteira. Nestes casos, o RPPS pode ser obrigado a liquidar os Valores Mobiliários a preços depreciados, podendo, com isso, influenciar negativamente o resultado da Carteira.

Nesse sentido, o Comitê deverá monitorar esse risco, de forma a realizar as movimentações que mantenham os recursos enquadrados à legislação. E no caso de se tratar de um mesmo emissor essa concentração não deverá ser superior a 20% do total dos recursos aplicados pela Amazonprev.

9. ASSET LIABILITY MANAGEMENT – ALM

A busca por ativos de renda fixa e renda variável, com adequada relação retorno-risco e vencimentos que coincidam com os pagamentos dos futuros benefícios, representam um dos grandes desafios da gestão da carteira de investimentos.

A tarefa mais árdua para um administrador de um Plano de Benefício Definido (BD), como é o caso dos RPPS, é a gestão de seus ativos. Sabe-se bem que retornos abaixo do esperado, no longo prazo, irão significar aumento de contribuição da parte patronal, já que o benefício está previamente definido.

Para atender a essas necessidades, consultores, atuários e profissionais de investimentos desenvolveram uma série de estudos, culminando no modelo hoje denominado por muitos de “ASSET LIABILITY MANAGEMENT - ALM”.



Trata-se de um modelo de gestão integrada de ativos e passivos que prima pela melhor alocação dos investimentos dos recursos garantidores dos planos de benefícios, considerando os retornos esperados e os riscos de cada segmento das aplicações, sempre respeitando as restrições legais e regulamentares, os compromissos atuariais desses planos, com os benefícios já concedidos e os a conceder. Trata-se de uma ferramenta altamente eficaz que visa proteger a sustentabilidade e a saúde de um sistema de previdência, seja de entidade aberta ou fechada. O objetivo principal é administrar as variantes de riscos, por isso se mostra imprescindível para uma gestão estratégica de instituições que gerenciam recursos de médio e longo prazos.

A aplicação desse estudo deve ocorrer após emissão de Parecer Técnico a ser fornecido por empresa especializada contratada por esta Fundação.

10. PRINCÍPIOS SÓCIOAMBIENTAIS

Os princípios sócios ambientais podem ser entendidos como um conjunto de regras que visam a favorecer o investimento em companhias que adotam, em suas atividades ou através de projetos, políticas de responsabilidade sócio ambiental.

A maneira mais comum de adoção desse conjunto de regras ocorre por meio da adesão a protocolos ou iniciativas lideradas por órgãos da sociedade civil e organismos internacionais, como a Organização das Nações Unidas (ONU).

A observância dos princípios sócio ambientais na gestão dos recursos depende, portanto, da adequação do processo de tomada de decisões, de forma que os administradores do RPPS tenham condições de cumprir as regras de investimento responsável.

Como o RPPS possui uma estrutura enxuta e focada no controle de riscos, decidiu-se que, ao longo da vigência desta política, os princípios sócios ambientais serão observados sempre que possível, sem adesão a protocolos e regras.



11. PROGRAMA DE EDUCAÇÃO FINANCEIRA

A Fundação Amazonprev buscará pela continuidade do Programa de Educação Financeira continuada, de forma a alcançar o objetivo da Certificação Profissional aos membros do Comitê de Investimentos e demais servidores que participam do Processo de Investimentos no RPPS, quais sejam Diretores e membros do Conselho de Administração e do Conselho Fiscal que ainda não tenham conseguido êxito na certificação, além de demais servidores da Amazonprev.

Esse processo deve ocorrer através da participação efetiva: nos eventos da ABIPEM e demais associações de RPPS aos quais a Amazonprev está conveniada, nas Palestras e/ou Seminários realizados por instituições financeiras credenciadas ou pelas empresas/entidades cujos temas propostos estejam diretamente voltados à área de investimentos dos RPPS, participação de reuniões periódicas com as instituições financeiras para prestação de contas relacionadas aos produtos de investimentos que a Amazonprev possui recursos aplicados.

É de especial importância a participação dos membros do Comitê nos encontros com as instituições financeiras através das diligências para verificação de lastros dos ativos das carteiras, devendo ser apresentado previamente o Cronograma de viagens para o exercício, de forma a atingir o máximo de instituições financeiras credenciadas ao RPPS, incluindo os Distribuidores de Produtos de Investimentos.

Importante registrar que a Lei nº 13.846, de 18 de junho de 2019, realizou alterações na Lei nº 9.717, de 27 de novembro de 1998, com destaque para a inclusão do art. 8º-B, que estabeleceu requisitos mínimos a serem atendidos pelos dirigentes, gestores de recursos e membros dos conselhos e comitês dos Regimes Próprios de Previdência Social – RPPS da União, dos Estados, do Distrito Federal e dos Municípios como condição para exercício das respectivas funções. O principal objetivo com essas alterações foi a melhoria do processo de escolha dos dirigentes, conselheiros, membros de comitê de investimentos dos regimes próprios e dos gestores dos recursos previdenciários, mediante a exigência de requisitos mínimos de qualificação pessoal e técnica desses profissionais, a exemplo dos procedimentos já adotados no âmbito do Regime de Previdência Complementar.



Inicialmente, o principal parâmetro para o cumprimento dessas exigências legais é o Manual de Certificação Profissional para os RPPS, que define o conteúdo mínimo e necessário para o aperfeiçoamento do processo de escolha desses profissionais e, por consequência, a melhoria do desempenho de suas atribuições, os quais, além do atendimento dos requisitos de qualificação pessoal, que serão considerados oportunamente, para fins de emissão do Certificado de Regularidade Previdenciária - CRP, deverão atender critérios mínimos de qualificação técnica, mediante comprovação de certificação emitida por processo realizado por instituição certificadora reconhecida pela Comissão de Credenciamento e Avaliação do Pró-Gestão RPPS, de que trata o art. 2º da Portaria SPREV nº 3, de 2018.

O preparatório para a Certificação Profissional deverá ocorrer em prazo hábil e através de entidade/instituição que esteja autorizada a realizar cursos e treinamentos específicos para essa atividade.

12. VEDAÇÃO AOS RPPS

A execução da Política de Investimento estatuída neste plano deve ser feita atentando às vedações previstas na legislação vigente, para qual o art. 28 da Resolução nº 4.963/2022, estabelece:

- I. Aplicar recursos na aquisição de cotas de fundo de investimento, cuja atuação em mercados de derivativos gere exposição superior a uma vez o respectivo patrimônio líquido;
- II. Aplicar recursos, diretamente ou por meio de cotas de fundo de investimento, em títulos ou outros ativos financeiros nos quais o ente federativo figure como emissor, devedor ou preste fiança, aval, aceite ou coobrigação sob qualquer outra forma;
- III. Aplicar recursos na aquisição de cotas de fundo de investimento em direitos creditórios não padronizados;
- IV. Praticar diretamente as operações denominadas daytrade, independentemente de o regime próprio possuir estoque ou posição anterior do mesmo ativo, quando se tratar de negociações de títulos públicos federais realizadas diretamente pelo regime próprio de previdência social;
- V. Atuar em modalidades operacionais ou negociar com duplicatas, títulos de crédito ou outros ativos que não os previstos na Resolução nº 4.963/2021;

29



- VI. Negociar cotas de fundos de índice em mercado de balcão;
- VII. Aplicar direta ou indiretamente recursos na aquisição de cotas de fundo de investimento destinado exclusivamente a investidores qualificados ou profissionais, quando não atendidos os critérios estabelecidos em regulamentação específica;
- VIII. Remunerar quaisquer prestadores de serviço relacionados direta ou indiretamente aos fundos de investimento em que foram aplicados seus recursos, de forma distinta das seguintes: taxas de administração, performance, ingresso ou saída previstas em regulamento; ou encargos do fundo, nos termos da regulamentação da CVM;
- IX. Realizar, de forma direta ou através do Governo do Estado do Amazonas, convênios ou contrato tendo como base exigência de reciprocidade relativa às aplicações dos recursos do RPPS;
- X. Além das vedações trazidas pela Resolução CMN nº. 4.963/2021 a Amazonprev, enquanto responsável por salvaguardar os recursos previdenciários, veda, ainda: Realização de operações financeiras em que o Administrador, o Gestor e o Custodiante do Fundo de Investimento não estejam devidamente credenciados junto à Fundação AMAZONPREV.

13. DISPOSIÇÕES GERAIS

A Política de Investimento, pautada nas normas regulamentares instituídas pelo Conselho Monetário Nacional, pela Secretaria de Previdência Social, do Ministério da Fazenda, e pela Lei Complementar nº. 30, de 27/12/2001, e alterações, demonstra que o Governo do Estado do Amazonas e a administração da AMAZONPREV adotaram como pilar mestre da gestão previdenciária a segurança no futuro.

A garantia de um Sistema Previdenciário equilibrado financeira e atuarialmente não se traduz apenas em segurança para o Estado, que se desincumbirá, ao longo dos anos, dessa obrigação, mas, sobretudo, para os servidores, segurados da previdência estadual, que abrem mão, mensalmente, de uma parcela de suas remunerações destinando-a à formação de uma “poupança” capaz de assegurar a concessão de benefícios, quando legalmente implementarem as condições.

A presente Política de Investimentos poderá ser revista a qualquer tempo, desde que devidamente justificada e aprovada pelos Conselhos, no decorrer do ano de sua vigência, a contar da data de sua





aprovação pelo Conselho de Administração, mediante parecer prévio do Conselho Fiscal (art. 78, I, “i”, da LC 30/2001).

O Conselho Diretor e o Comitê de Investimentos ratificam o compromisso de seguir as diretrizes traçadas neste Plano, o qual está em consonância com toda a legislação que rege a matéria, de sorte a salvaguardar os interesses dos segurados da Previdência Estadual, titulares do patrimônio previdenciário, procurando gerir, responsabilmente, os recursos desse patrimônio e consolidar a imagem da Instituição junto a seu público-alvo, ao Ente Patrocinador, aos Conselhos e à sociedade em geral.

Esta Política de Investimento entrará em vigor em 01 de janeiro de 2023 com aplicação até 31 de dezembro de 2023.

**GABINETE DA DIRETORIA E COMITÊ DE INVESTIMENTOS DA FUNDAÇÃO
AMAZONPREV. Manaus, 16 de novembro de 2022.**

MARIA NEBLINA MARÃES
Diretora-Presidente





GOVERNO DO ESTADO DO AMAZONAS
AMAZONPREV – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



Processo Nº: 2022.A.08685	Data: 20/12/2022
Poder:	Órgão:
Fundo: FUNDO PREVIDENCIARIO	
Assunto: PROCESSOS ADMINISTRATIVOS	
Tipo de Processo: MEMORANDO	
Servidor: COMIV	
Matrícula:	
ANEXOS:	
SUMULA: Parecer Atuarial-Taxa de juros parâmetro	



Mem. nº. 205 / 2022 / COMIV

Manaus, 20 de dezembro de 2022.

À Diretoria de Administração e Finanças – DIRAF.

Assunto: Parecer Atuarial – Duração do Passivo – Taxa de Juros Parâmetro

Referência: *Proc 2022.A.08685*

Senhor Diretor,

O Comitê de Investimentos tomou ciência, em reunião ordinária de 16/12/2022, sobre Parecer Atuarial, emitido pela empresa Actuarial em 14/12/2022, responsável pelo Cálculo Atuarial e análise da Rentabilidade da Carteira da Amazonprev, onde foi registrada a orientação da Secretaria da Previdência, constante da Portaria 1.467/2022, para a possibilidade de acréscimo em 0,15% a 0,60% à taxa de juros parâmetro para definição da meta atuarial do próximo exercício, conforme meta atuarial alcançada nos últimos 05 (cinco) anos.

Também ficou registrado que o aumento da taxa é favorável para o resultado atuarial e aumento do superávit atuarial do plano previdenciário do RPPS, sendo recomendado pela Actuarial o aumento sobre a taxa de juros parâmetro de 0,30%, elevando a taxa de 4,82% para 5,12% ao ano, de forma que a meta atuarial para o próximo exercício passará para: IPCA + 5,12% ao ano.

O Comitê de Investimentos, após entendimento e discussão sobre o tema, votou por encaminhar à Diretoria o referido Parecer com o registro em Ata de Reunião do voto favorável a alteração da meta atuarial já aprovada pelos Conselhos nas reuniões de novembro/2022 dentro da Política de Investimentos-2023. Assim, caso a Diretoria esteja de

(MPR 04 F11)





acordo com a sugestão apresentada, que a proposta para atualização da meta atuarial para 2023 seja apresentada aos Conselhos de Administração e Fiscal, responsáveis pela aprovação da Política de Investimentos da Amazonprev.

Respeitosamente,

(assinado digitalmente)
Alan Nascimento
COMIV

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/12/2022 11:18:42

Documento assinado eletronicamente 242523/2022

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

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



(MPR 04 F11)

PARECER ATUARIAL – DURAÇÃO DO PASSIVO TAXA DE JUROS PARÂMETRO

Em atendimento à normatização federal vigente e aplicável às avaliações e reavaliações atuariais de Regimes Próprios de Previdência Social no Brasil informamos a Diretoria e ao Comitê de Investimentos da **Fundação Amazonprev** os valores da taxa de juros parâmetro calculada a partir da duração do passivo do **Fundo Previdenciário (FPREV)** gerido pelo RPPS estadual.

Na próxima avaliação atuarial do exercício 2023, deveremos adotar todas as novas definições da nova Portaria **1.467/2022**, incluindo a nova taxa de juros parâmetro baseada na duração do passivo do plano, conforme a tabela de juros da **Portaria 1.837/2022**.

O cálculo da duração do passivo demonstra o tempo médio necessário para o plano pagar seu passivo. Desta forma se estabelece um parâmetro de idade para o plano, onde quanto maior a duração do passivo, mais jovem é o plano.

A tabela de juros da **Portaria 1.837/2022** relaciona o tempo de duração do plano, com uma média de retorno ou rentabilidade dos títulos públicos para cada período de tempo. Ou seja, para a duração de 24,31 anos do seu RPPS, o retorno médio dos títulos públicos com este prazo seria de no máximo 4,82% ao ano.

Tabela 1. Meta Atuarial – Fundo Previdenciário – 2017 a 2021:

Ano	Rentabilidade Anual	% Rentabilidade	Meta Atuarial %	% Atingido da Meta
2017	329.570.902,80	11,62%	9,13%	+2,49%
2018	293.874.598,88	8,36%	9,98%	-1,61%
2019	657.714.887,83	15,05%	10,57%	+4,48%
2020	239.542.987,27	4,43%	10,67%	-6,24%
2021	55.311.370,69	0,98%	16,06%	-15,08%

Portaria 1.467/2022

Art. 39...

§ 4º A taxa de juros parâmetro, estabelecida conforme o Anexo VII, poderá ser acrescida em 0,15 (quinze centésimos) a cada ano em que a rentabilidade da carteira de investimentos superar os juros reais da meta atuarial dos últimos 5 (cinco) anos, limitados ao total de 0,60 (sessenta centésimos).

Considerando que a rentabilidade dos investimentos do FPREV superou a meta em dois anos no período de 2017 a 2021, seria possível acrescentar até 0,3 pontos percentuais na taxa de juros parâmetro, chegando a **5,12% ao ano**.

Tabela 2. Evolução da Taxa de Juros Parâmetro:

Exercício	Duração do Passivo	Taxa Parâmetro	Base Legal
Até 2019	-	6,00% ao ano	Portaria 403/2008
2020	25,73 anos	5,88% ao ano	Portaria 17/2019
2021	25,42 anos	5,45% ao ano	Portaria 12.233/2020
2022	23,97 anos	4,95% ao ano	Portaria 6.132/2021
2023	24,31 anos	4,82% + 0,30% = 5,12% ao ano	Portaria 1.837/2022

Ressaltamos que o aumento da taxa de juros é sempre favorável para o resultado atuarial e aumento do superávit atuarial do plano previdenciário gerido pelo RPPS.

Desta forma, recomendamos que seja adotada a taxa máxima permitida para a duração do passivo do fundo previdenciário como meta atuarial na Política de Investimentos para 2023.

A revisão anual da taxa de juros utilizada nas avaliações atuariais, visa adequar a expectativa de rendimentos futuros com as aplicações financeiras com a realidade do mercado e das limitações de investimentos impostas pela normatização federal.

Eis nosso parecer,

Curitiba, 14 de dezembro de 2022.



Luiz Cláudio Kogut
Atuário - Miba 1.308

ACTUARIAL - ASSESSORIA E CONSULTORIA ATUARIAL LTDA.

DELIBERAÇÃO SUPERIOR

ORIGEM: COMIV	MEM. N.º 205/2022-COMIV	DESTINAÇÃO: CODIR
ASSUNTO: ALTERAÇÃO DA META ATUARIAL PARA O EXERCÍCIO DE 2023. (PROCESSO 2022.A.08685)		DATA: 20/12/2022
ANEXOS:		
Senhora Diretora Presidente:		
<ol style="list-style-type: none"> 1. Trata de alteração da meta atuarial para o exercício de 2023. A meta foi definida no PAI – 2023 e já deliberada pelo CODIR, COFIS e CONAD. 2. Conforme Memorano nº 205/2022 – COMIV, a empresa Actuarial, responsável pelo Cálculo Atuarial e análise da Rentabilidade da Carteira da Amazonprev, foi registrada a orientação da Secretaria da Previdência, constante da Portaria 1.467/2022, para a possibilidade de acréscimo em 0,15% a 0,60% à taxa de juros parâmetro para definição da meta atuarial do próximo exercício, conforme meta atuarial alcançada nos últimos 05 (cinco) anos. 3. É o relato em 21/12/2022. 		
VOTO DA DIRAF		
<ol style="list-style-type: none"> 1. Considerando o Memorando nº 205/2022 – COMIV, onde informa que o aumento da taxa é favorável para o resultado atuarial e aumento do superávit atuarial do plano previdenciário do RPPS, sendo recomendado pela Actuarial o aumento sobre a taxa de juros parâmetro de 0,30%, elevando a taxa de 4,82% para 5,12% ao ano, de forma que a meta atuarial para o próximo exercício passará para: IPCA + 5,12% ao ano. Considerando também o Parecer Técnico da empresa Actuarial constante nos autos deste processo. Esta DIRAF recomenda <u>A FAVOR</u> da alteração conforme orientação do Comitê de Investimentos desta Instituição. 2. Encaminho ao CODIR para deliberação, após, se aprovado, que seja encaminhado ao COFIS e CONAD para apreciação. <p style="margin-left: 40px;">É o voto que submeto na reunião ordinária em: 21 / 12 / 2022.</p> <p>(assinado digitalmente) Miltonir Corrêa Lima Diretor de Administração e Finanças</p>		
AD REFERENDUM		
<i>AD REFERENDUM</i>		
Autorizo, “AD Referendum”, devendo o assunto ser submetido ao Conselho Diretor.		
Assinatura Eletrônica PRESIDENTE DO CONSELHO DIRETOR		



ORIGEM: COMIV	PARECER n.º. 397/2022	DESTINAÇÃO: DIRAF
ASSUNTO: PLANO DE APLICAÇÕES E INVESTIMENTOS – PAI 2023		DATA: 09/11/2022

ANEXOS:

Senhores Diretores,

Em cumprimento aos termos estabelecidos no Manual de Procedimentos – MPR 17, Capítulo 1 - item 2, o Comitê de Investimentos da Amazonprev encaminha para análise e Deliberação dessa Diretoria o Plano de Aplicações e Investimentos – PAI, ou Política de Investimentos, para o exercício de 2023.

Destaca-se no PAI 2023:

1. Meta Atuarial: A tabela de juros da Portaria SPREV N° 1.837/2022 relaciona o tempo de duração do plano, com uma média de retorno ou rentabilidade dos títulos públicos para cada período de tempo. Ou seja, para a duração de 24,31 anos do RPPS, o retorno médio dos títulos públicos com este prazo seria de 4,82% ao ano. Assim, esta taxa deverá ser adotada para a meta de retorno esperado na Política de Investimentos em 2023, **IPCA + 4,82% a.a.** Este percentual será recalculado anualmente e, provavelmente, a tabela da taxa de juros de parâmetro será atualizada anualmente pela Secretaria de Previdência;
2. O Cenário tomou como base as informações apresentadas no Relatório FOCUS, emitido semanalmente pelo BACEN. Também consta o registro de fatos recentes que podem impactar nas interpretações do mercado financeiro, tais como: eleições 2022 e recessão global;
3. A Estratégia para Alocação de Recursos foi definida com base nos limites e produtos definidos na Resolução CMN n.º. 4.963/2021. O Comitê sugere uma Carteira de Investimentos diversificada, com alocação de Recursos em Renda Fixa, Renda Variável e fundos de Investimentos no Exterior, além do aumento na exposição em FIPs e demais segmentos estruturados;
4. Registro de educação financeira continuada, onde no entendimento do Comitê, além da Certificação Profissional dos Gestores do RPPS, é necessária a participação dos gestores e demais membros do Comitê e



Conselhos na participação de eventos direcionados a esse público como: palestras, seminários, congressos e cursos específicos.

Assim, o Comitê de Investimentos da Amazonprev, após discussão e registro em Ata de reunião Ordinária, ocorrida em 17/10/2022, encaminha para apreciação e posterior Aprovação dessa Diretoria, o Plano de Aplicações e Investimentos – PAI para o exercício de 2023, e em caso positivo, deve ser encaminhado para aprovação definitiva pelos Conselhos COFIS e CONAD.

Respeitosamente,

À Superior Consideração

Alan Nascimento
Coordenador COMIV



Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 09/11/2022 12:41:17

Documento assinado eletronicamente 226130/2022

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

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

e valide o código: MjJzMTMw



ATA DA 192ª (CENTÉSIMA NONAGÉSIMA SEGUNDA) REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS – COMIV – FUNDAÇÃO AMAZONPREV – REALIZADA EM 17 DE OUTUBRO 2022.

DATA, HORA E LOCAL: Aos 17 (dezesete) dias do mês de outubro do ano de 2022, às 09:00 horas, reuniram-se presencialmente os membros do Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev: **Alan Cynara Batista Nascimento, matrícula nº 160994-7 C, Bruno Damasceno Costa Novo, matrícula nº 216821-9 B, Claudinei Soares, matrícula nº 216.006-4 A, Leonardo Almeida de Siqueira Cavalcanti, matrícula nº 179561-9 B, Wellington Guimarães Bentes, matrícula nº 215.468-4 A, Sr. Bruno Rene da Silva Barroso, matrícula nº 249252-0 A e o Sr. Marcos Roberto Nascimento De Souza nº. 249.152-4 A** - (Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas). Também participaram da reunião os membros do Conselho Fiscal Maria da Conceição Guerreiro da Silva e Afrânio Correa Lima Junior. Iniciada a reunião, foram discutidos os seguintes temas: **1. DELIBERAÇÕES ANTERIORES:** Dada a ciência aos membros do Comitê que a Diretoria da Amazonprev, através do Despacho de 26/09/2022, constante do Processo 2022.A.06466, deliberou pelo *deferimento* de todas as sugestões apresentadas pelo Comitê e registradas na Ata de Reunião nº. 191/2022. A respeito da utilização da alçada pelo Comitê, nas aplicações em fundos de Capital Protegido, a Diretoria reforçou “que tais situações sejam evitadas, por mais que os produtos sejam uma ótima oportunidade naquele momento, em conformidade ao Manual de Política de Alçadas, item 2.3, à aprovação das estratégias de investimentos propostas na Ata de Reunião cabe à Diretoria de Administração e Finanças, em conjunto com a Diretora Presidente”. No entanto, foi lembrado que as operações seguiram as orientações da Política de Limite de Alçadas, que estabelece as linhas gerais do processo, além de cumprir integralmente o Manual de Procedimentos de Investimentos (MPR-17), onde a metodologia e os critérios do processo, de investimento e desinvestimento, estão registrados em detalhes. Também foi registrado sobre as aquisições de letras financeiras (LF), onde foi observado que, no momento não vê oportunidades conforme registros anteriores, as taxas desses ativos estão abaixo do que o Comitê entende como ideal, haja vista o risco de crédito envolvido e a rentabilidade que o mercado financeiro observa através do CDI. A Respeito do resgate de cotas positivas de fundos de investimentos no exterior, não foram identificadas cotas positivas para esses ativos até essa data, mas que seguirá o acompanhamento até o cumprimento da ação ou alteração do entendimento. **2. RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS, CENÁRIO E RESULTADOS.** Com base na avaliação dos dados da Carteira de Investimentos, realizada



ATA DA 192ª (CENTÉSIMA NONAGÉSIMA SEGUNDA) REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS – COMIV – FUNDAÇÃO AMAZONPREV – REALIZADA EM 17 DE OUTUBRO 2022.

pela empresa Actuarial, seguem os resultados para o mês atual: **a) Rentabilidade FPREV - Executivo.** Rentabilidade de -0,1182% no mês, com acumulado em 2022 de 1,7430% e em 12 (doze) meses de 1,6436%, a Meta Atuarial em 0,1123% no mês, 7,9305% no ano e 12,4734% em 12 (doze) meses. **b) Rentabilidade FPREV - ALE** no mês de -0,6727%, com acumulado em 2022 de 0,89502% e em 12 meses de 0,13612%. **c) Rentabilidade FPREV Ministério Público Estadual – MPE / PGJ.** A rentabilidade no mês de 0,1132%, com acumulado em 2022 de 6,4034% e em 12 meses de 6,1196%. **d) Rentabilidade FPREV do Tribunal de Justiça.** A rentabilidade no mês de -0,0463%, com acumulado em 2022 de 4,5058% e em 12 meses de 6,6168%. **d) Rentabilidade FPREV do Tribunal de Contas.** A rentabilidade no mês de 0,3909%, com acumulado em 2022 de 7,4976% e em 12 meses de 8,9082%. **e) Rentabilidade FPREV da Defensoria Pública.** A rentabilidade no mês de 0,0913%, com acumulado em 2022 de 5,2726% e em 12 meses de 7,1484%. Por fim, considerando os resultados **Consolidados** da AMAZONPREV/FPREV, o Comitê registra rendimentos no mês de **setembro/2022** de -0,0937%, abaixo da meta atuarial em -0,2057%. Em 12 meses o acúmulo é de 2,38%, ficando aquém da meta em -8,9741% no período. **2.1 Registros de Cenário e Expectativas:** Brasil: O Banco Central manteve a taxa Selic em 13,75% ao ano, encerrando assim o ciclo de alta de juros. Mundo: Bancos Centrais do mundo mantém política monetária em direção restritiva. O Banco Central manteve a taxa básica em 13,75% ao ano. O Copom entendeu que a decisão é compatível com a estratégia de convergência da inflação para o redor da meta ao longo do horizonte relevante, que inclui o ano calendário de 2023 e, em menor grau, o de 2024. De acordo com o comunicado, o Banco Central avalia que o ambiente externo se manteve adverso e volátil, com maiores revisões negativas para o crescimento global, em especial para a China, e um ambiente inflacionário persistente. O comitê acrescentou a percepção acerca do processo de normalização da política monetária nos países avançados em direção às taxas restritivas. Domesticamente, a inflação ao consumidor continuou elevada, ao passo que os indicadores de atividade econômica apontam crescimento acima do esperado no segundo trimestre. No balanço de riscos, o Copom elencou fatores em ambas as direções. Do lado altista, manteve a preocupação das pressões inflacionárias globais e possíveis estímulos fiscais domésticos adicionais e acrescentou um hiato do produto mais apertado que o utilizado pelo comitê. Do outro lado, o Copom aponta a



ATA DA 192ª (CENTÉSIMA NONAGÉSIMA SEGUNDA) REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS – COMIV – FUNDAÇÃO AMAZONPREV – REALIZADA EM 17 DE OUTUBRO 2022.

reversão dos preços de commodities e a possibilidade de desaceleração da atividade econômica mais acentuada que o esperado, além de uma possível manutenção dos cortes de tributos projetados para serem revertidos em 2023. Sobre os próximos passos, o Copom se manterá vigilante acerca da manutenção da taxa básica de juros e salientou que não hesitará em retomar o ciclo de ajuste, caso o processo de desinflação não transcorra como esperado. O Banco Central deverá manter a taxa de juros no patamar atual por alguns trimestres até que a inflação comece a convergir para níveis compatíveis com as metas de 2023 e 2024. Em setembro, a prévia da inflação ao consumidor (IPCA-15) mostrou queda de 0,37%, marcando o segundo mês de deflação. O resultado veio abaixo da mediana do mercado (-0,18% e -0,20%, respectivamente). Com isso, a inflação acumulada em 12 meses desacelerou, de 9,60% no IPCA-15 de agosto para 7,96% em setembro. Os maiores desvios vieram dos grupos de comunicação (-2,74%), transportes (-2,35%) e alimentação e bebidas (-0,47%). O núcleo de serviços subjacentes desacelerou de 0,73% no resultado fechado de agosto para 0,65% na prévia de setembro. Vale destacar que para o grupo de preços monitorados, os últimos três resultados apresentaram desaceleração média de 2,53% por mês, grande parte puxada por combustíveis. No mês, os preços de gasolina e etanol recuaram 9,78% e 10,10%, respectivamente. Com relação aos núcleos, que são métricas que excluem ou suavizam itens voláteis, a média anualizada de três meses com ajuste sazonal voltou também a aliviar, de 9,84% para 8,71%, reforçando o processo de desaceleração da inflação, apesar dos núcleos ainda estarem em patamares elevados. Em 12 meses, a média dos núcleos alcançou 10,25%. A tendência é que o processo de desaceleração continue nos próximos meses, fazendo com que o IPCA alcance as variações de 5,3% e 4,9% para 2022 e 2023, nessa ordem. Nos EUA, o Fed elevou a taxa de juros básica para o intervalo entre 3,00% e 3,25% ao ano, em decisão unânime. A respeito do cenário, prevalece a leitura de inflação elevada e com pressão disseminada, refletindo choques de oferta e demanda relacionados à pandemia, alta da inflação de alimentos e energia. Sobre atividade, os membros reconheceram que os indicadores mais recentes apontaram desaceleração do consumo e da produção, embora o mercado de trabalho permaneça robusto. O comitê reafirmou que segue “fortemente comprometido” com a meta de inflação de 2% e manteve a sinalização que novos ajustes serão necessários. Em relação às projeções, houve elevação da trajetória para a inflação e taxa de juros e piora das expectativas



ATA DA 192ª (CENTÉSIMA NONAGÉSIMA SEGUNDA) REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS – COMIV – FUNDAÇÃO AMAZONPREV – REALIZADA EM 17 DE OUTUBRO 2022.

para a taxa de desemprego. Para 2022, a projeção para o núcleo de inflação subiu de 4,3% em junho para 4,5%, enquanto para 2023 a projeção subiu de 2,7% para 3,1% e para 2024 permaneceu em 2,3%, ao passo que o Fed projeta inflação de 2,1% em 2024. No mercado de trabalho, a projeção para a taxa de desemprego teve alta de 3,7% para 3,8% em 2022, e de 3,9% para 4,4% em 2023, acompanhando a piora das expectativas de crescimento do PIB. Por fim, a perspectiva sobre a trajetória de juros dos membros do Fed sofreu alterações relevantes. A mediana dos votos indicou taxa de juros básica em 4,4% ao final de 2022 e 4,6% em 2023, recuando para 3,9% em 2024 e para 2,9% em 2025. O Fed, portanto, considera manter a taxa de juros acima da taxa neutra (2,5%) por todo o horizonte relevante. A BRAM contempla alta de 75 pb na reunião de novembro e 50 pb em dezembro, encerrando o ciclo com a taxa de juros em 4,75%. Em uma semana com diversas decisões de política monetária, dando continuidade ao ciclo de elevação da taxa de juros, o Banco da Inglaterra decidiu, em decisão não unânime, pela elevação da taxa de juros do país em 0,50 p.p. Com essa decisão, em linha com as expectativas do mercado, a taxa de juros chegou a 2,25% ao ano. Além disso, o comitê decidiu iniciar imediatamente as vendas de ativos adquiridos pelo Banco Central com a finalidade de reduzir seu balanço patrimonial. Por outro lado, o Banco do Japão manteve inalterada a taxa de juros do país, em -0,10% a.a. Foi mantido o viés expansionista de política monetária em sua comunicação, esperando por evidências adicionais para uma eventual alta de juros no país. No entanto, o ministério das Finanças do Japão anunciou uma intervenção no mercado cambial para sustentar o iene, que tem mostrado forte depreciação em relação ao dólar desde março, em um contexto de crescente discrepância entre as políticas monetárias americana e japonesa. Por fim, a economia chinesa mostrou leve recuperação em agosto, mas ainda cresce em ritmo fraco. No mês passado, a produção industrial avançou 4,2% na comparação com mesmo período do ano passado, superando o esperado (3,8%) e a alta registrada em julho (3,8%). Da mesma forma, os investimentos em ativos fixos acumularam expansão de 5,8% até agosto, puxados pelo segmento de infraestrutura, surpreendendo positivamente as expectativas (5,5%) e o acumulado até julho (5,7%). Por fim, mesmo que o consumo das famílias siga fraco diante das restrições de mobilidade ainda presentes em muitas partes do país e do nível muito baixo da confiança, as vendas do varejo subiram 5,4% na comparação interanual, acima das projeções (3,3%), acelerando ante a expansão de 2,7%



ATA DA 192ª (CENTÉSIMA NONAGÉSIMA SEGUNDA) REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS – COMIV – FUNDAÇÃO AMAZONPREV – REALIZADA EM 17 DE OUTUBRO 2022.

verificada em julho. O destaque negativo continuou concentrado no setor imobiliário, com lançamentos, vendas e preços de novos imóveis residenciais registrando quedas respectivas de 47,2%, 24,5% e 2,1% em agosto em relação ao mesmo mês do ano anterior. Dessa forma, a economia chinesa tem mostrado certa estabilização, em nível muito baixo de crescimento (ao redor de 3%) e os riscos baixistas à frente se devem essencialmente à desaceleração estrutural do setor de construção residencial e à política de controle de casos de Covid-19. Mesmo assumindo que mais estímulos serão adotados nos meses seguintes, a retomada tende a ser bastante moderada. (Fonte: BRAM – Síntese Mensal – setembro/2022).

3. ESTRATÉGIAS PARA O PRÓXIMO PERÍODO. Em Setembro, o preço da Energia na Europa foi tema central das discussões, reforçando a preocupação com a inflação, que segue elevada na Europa e EUA, que ainda realizam movimento coordenado de alta de juros. Ainda, a atividade industrial segue desacelerando no mundo, preços das commodities estáveis, porém os dados de serviços seguem indicando uma aceleração da atividade nesse setor. Mesmo com taxas de juros em ambiente restritivo, o risco de países emergentes aumentou, com impacto nos resultados do mercado para a renda variável. Esse movimento de juros no mundo não impactou na taxa de juros local, que continuou um movimento de queda no mercado futuro, se traduzindo em um resultado mais positivo, para os ativos indexados ao IMA, o IMA B5+ fechou setembro com valorização de 2,39% contra 1,07% do CDI. Porém, o cenário onde a taxa de juros deve permanecer em 13,75% até o primeiro trimestre de 2023 é favorável ao CDI, pois o Comitê projeta que a rentabilidade média para o próximo exercício será acima de CDI+, o suficiente para superar a meta atuarial nesse segmento. Para o curto prazo, a estratégia mais adequada está voltada à Renda Fixa, pois o Cenário para o mercado de Ações tem muitas incertezas e, internamente, os resultados das eleições ao fim deste mês pode destravar as barreiras de alta do índice, elevando os resultados até o fim do exercício. No entanto, algumas movimentações de ajuste da carteira em Renda variável e Investimentos no exterior não estão descartadas, e que devem ser feitas com cautela, devido ao cenário de volatilidade para o segmento e a possibilidade de realização de cotas negativas, que pode impactar negativamente na carteira do RPPS. Desta feita, o comitê sugere: **3.1. FPREV: a) Novos Recursos Executivo:** Ratear entre os fundos BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90), BB PREVID RF PERFIL (13.077.418/0001-49), CAIXA FI BRASIL



ATA DA 192ª (CENTÉSIMA NONAGÉSIMA SEGUNDA) REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS – COMIV – FUNDAÇÃO AMAZONPREV – REALIZADA EM 17 DE OUTUBRO 2022.

REF DI LP (03.737.206/0001-97). A opção por esses ativos está relacionada aos limites estabelecidos na legislação vigente, uma vez que, no momento, não há mais espaço para novas aplicações em fundos de Crédito Privado, ainda, são ativos com PL elevado, possibilitando aumentar posição sem risco de superar os limites da legislação. **b) Demais Recursos:** Resgate de 3% de fundos de RV com cotas positivas, se houver, para alocação nos fundos de Renda Fixa: BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90), BB PREVID RF PERFIL (13.077.418/0001-49), CAIXA FI BRASIL REF DI LP (03.737.206/0001-97). A decisão parte do entendimento do Comitê em garantir a rentabilidade observada nos fundos de ações, além de reduzir a volatilidade da carteira. Votaram dessa forma os Srs. Bruno Barroso, Claudinei, Wellington e Leonardo, por entenderem que a filosofia dos investimentos de um RPPS é de longo prazo, mesmo se os fundos de investimentos registrarem desempenho abaixo do esperado no curto prazo, evitando a realização de prejuízo, devendo ser observados a performance dos fundos a partir de janelas de pelo menos 36 (trinta e seis) meses, e que quotas positivas em ações devem ser realizadas e realocadas em outros segmentos, a fim de preservar a rentabilidade positiva obtida. Os Srs. Alan e Bruno Novo, entendem que o cenário externo está cada vez mais incerto, a volatilidade dos ativos tem impactado os resultados, e aumentar a exposição em Renda Fixa para acima de 80% da carteira poderá melhorar o resultado da Amazonprev, migrando parte dos recursos aplicados em fundo IE e S&P 500 é mais acertado, e entendem que deve-se manter aplicação em Renda Variável, pois a análise gráfica sugere viés de alta do Ibovespa, o que deverá maximizar os resultados da carteira até o final do exercício. **3.2 FPREV ALE: a) Novos Recursos:** aplicar no fundo BB PREVID RF PERFIL (13.077.418/0001-49). **3.3 OUTROS PODERES MPE / DPE / TJA / TCE FPREV. a) Novos Recursos:** Direcionar para o fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90). No entanto, por questões operacionais e considerando a existência de despesas no FPREV desses Poderes, cujos valores são inferiores ao resgate mínimo do fundo DI PREMIUM, qual seja, R\$ 200.000,00, a Coordenadoria Financeira fica autorizada a destinar parte do recurso de arrecadação previdenciária no fundo Bradesco Maxi Poder Público de acordo com a necessidade de cada folha de pagamento, facilitando, assim, a rotina de pagamentos. **3.4 Fundo Financeiro - EXECUTIVO, ALE, DPE, MPE, TCE, TJAM FFIN e Recursos FPPM:** Aplicar os recursos no fundo Bradesco Maxi Poder Público,



ATA DA 192ª (CENTÉSIMA NONAGÉSIMA SEGUNDA) REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS – COMIV – FUNDAÇÃO AMAZONPREV – REALIZADA EM 17 DE OUTUBRO 2022.

facilitando a operacionalização dos pagamentos das folhas de inativos e pensionistas desses órgãos. Devendo ser observados os limites para aplicação conforme legislação vigente. **3.5. COMPREV. Novos recursos:** Direcionar para o fundo Bradesco Maxi Poder Público. **3.6 Recursos da Taxa de ADM:** Manter aplicados no fundo Maxi Poder Público. O Sr. Alan reforçou que está autorizada a área financeira, para os casos em que não haja tempo hábil para aplicação no último dia do mês, a aquisição de CDB do Bradesco, evitando manter saldo em conta corrente entre um mês e outro. **4. POSIÇÃO ATUALIZADA DA CARTEIRA.** Registra-se a posição de 13/10/2022: **FPREV EXECUTIVO:** Total de Recursos: R\$ 5,594 bilhões, sendo Fundos de Investimento: R\$ 3,443 bilhões; TPF: R\$ 2,058 bilhões contabilizados pelo custo de aquisição acrescido da rentabilidade contratada; Títulos CVS: R\$ 7,488 milhões; Imóveis: R\$ 68,293 milhões. **FPREV ALE:** R\$ 19,436 milhões em fundos e TPF. **FPREV MPE/AM:** R\$ 218,195 milhões aplicados em fundos e TPF. **FPREV TJAM:** R\$ 566,429 milhões aplicados em fundos e TPF. **FPREV TCE/AM:** R\$ 136,991 milhões aplicados em Fundos e TPF. **FPREV DPE/AM:** R\$ 51,664 milhões aplicados em Fundos e TPF. O Total de Recursos da Amazonprev, na data informada, considerando todas as aplicações e disponibilidades é de **R\$ 6,670 bilhões.** **5. CONSULTORIA LDB E SISTEMA BROADCAST:** Foi dada ciência sobre a conclusão dos processos de contratação da Consultoria da LDB Empresas, sendo que já temos acesso ao sistema, que já foram disponibilizados os dados via extratos e controles em planilha conforme solicitado pelo operacional da empresa, e que em breve estará disponível para acesso dos membros do comitê e demais participantes do processo de investimentos, que está programada reunião com os representantes da LDB Empresa para o dia 21/10/2022. O sistema Broadcast, além das informações de mercado financeiro, é possível gerar relatórios da carteira, acompanhamento dos fundos por segmento, além de efetuar comparativos e simular Carteira eficiente, e muitos outros, já foi realizado treinamento aos membros Alan Nascimento, Bruno Damasceno e Claudinei Soares. **6. NOVOS PRODUTOS:** O Comitê de Investimentos recebeu as sugestões de produtos Rio Bravo Bolsa Americana II e Fundo Safra Capital Garantido Bolsa Americana II, com estruturas semelhantes, gerando proteção ao Capital Investido com o retorno que variam entre 15% a 24%, no pior cenário, e a variação total do índice S&P 500 no melhor dos cenários. Dado que o início das aplicações é ao final do mês de outubro/2022



ATA DA 192ª (CENTÉSIMA NONAGÉSIMA SEGUNDA) REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS – COMIV – FUNDAÇÃO AMAZONPREV – REALIZADA EM 17 DE OUTUBRO 2022.

não havendo tempo hábil para avaliação da Diretoria, o Comitê encaminha pela não aplicação nesses produtos. Destaca que as operações, comandadas pelo COMIV, estariam amparadas pela Política de Limites de Alçadas da Amazonprev, bem como cumpriria integralmente o item 13.1.2 do Manual de Procedimentos MPR17. **7. CREDENCIAMENTO DE INSTITUIÇÃO FINANCEIRA:** O Sr. Alan registrou que a instituição financeira BGC CTVM, que solicitou credenciamento como Corretora de Títulos e Valores Mobiliários através do Proc. 2022.A.05326, e que não teve aprovação pelo Comitê pelo motivo: não constar da lista de dealers do Tesouro Nacional. No entanto, foi identificado que houve um erro por parte do Comitê na descrição desse critério, a lista consultada para definição das instituições foi do Banco Central. Por esse motivo, foi sugerida a alteração no Manual de Procedimentos MPR 17 para inclusão do texto: “10. Somente serão aceitos os Requerimentos das Instituições Financeiras Corretoras ou Distribuidoras de Valores Mobiliários que estejam selecionados e listadas pelo Tesouro Nacional e Banco Central a operar como Dealers...”, devendo o Parecer ser Retificado, as CNDs atualizadas e reenviado o processo para Homologação da Diretoria. Todos foram de acordo. **7.1 Credenciamento on-line:** O Sr. Alan informou a todos os presentes que a abertura de Chamado para a empresa Agenda Assessoria referente a Credenciamento de Instituições Financeiras, de forma on-line, não foi atendido em sua integralidade. Apesar de ser possível acessar o módulo através do link disponibilizado no site da Amazonprev, o sistema não permitia incluir a inclusão dos anexos, e mesmo após concluir essa etapa, os documentos não eram recebidos no Processo gerado. Dada que a solicitação em desenvolvimento é data de junho/2021, o Comitê registra a falha nesse processo e a demora na conclusão do chamado. Portanto, o Comitê entende que se o problema não for solucionado de imediato, será encaminhado expediente dispensando esse módulo ofertado pela Agenda, ainda, foi pedido para que se apurasse, junto ao processo de pagamento, se foi acrescido o valor referente ao módulo nos pagamentos efetuados à essa empresa, pois em todos os testes realizados pela equipe de investimentos, e tentativas frustradas das instituições financeiras, a empresa foi informada através de email. **8. PLANO DE APLICAÇÕES E INVESTIMENTOS – PAI 2023:** O Sr. Alan comentou sobre as principais alterações propostas do PAI 2023, dentre elas: taxa de crescimento real de 4,82% para a meta atuarial; previsão de recursos para 2023 de R\$ 8 bilhões em caso de cenário favorável; cumprimento



ATA DA 192ª (CENTÉSIMA NONAGÉSIMA SEGUNDA) REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS – COMIV – FUNDAÇÃO AMAZONPREV – REALIZADA EM 17 DE OUTUBRO 2022.

de todos os critérios para os investimentos de forma a garantir alcançar o Nível IV do Pró Gestão, reforçando que não é necessário o RPPS estabelecer programa de Perícia Médica, como buscava-se fazer anteriormente, dentre outros. Destacou que o Cenário para 2023 ainda está em fase de elaboração devido a dinâmica do mercado e a espera dos resultados do 2º turno das eleições 2022, da mesma forma que a estratégia de alocação de recursos, que aguarda a produção do Estudo ALM a ser elaborado pela empresa de Consultoria. Assim, foi aprovado pelos membros do Comitê o texto base da Política de Investimentos 2023, cujo Parecer deverá ser encaminhado à Diretoria após atualização de Cenário e definição da estratégia de alocação.

09. SUBSTITUIÇÃO DE CUSTÓDIA PARA OS TÍTULOS PÚBLICOS. Para atualização, que já foram iniciadas as tratativas de portabilidade dos Títulos Públicos do Tesouro para a XP Investimentos, concluída abertura de conta, e levantamento dos documentos de compra dos ativos. Foi reforçado que fez-se necessária a mudança visto a qualidade dos Relatórios e possibilidade de customização conforme as necessidades da Amazonprev, facilitando o gerenciamento dos ativos e, principalmente, a possibilidade de gerar as informações necessárias para inclusão no DAIR. **10. ENCERRAMENTO.** Não havendo mais nada a tratar, foi encerrada a reunião, ficando prevista para o dia 16/11/2022 a próxima reunião Ordinária do Comitê, que poderá contar com a participação de representantes do Conselho Fiscal, da qual eu, Alan Nascimento, coordenador do COMIV, redigi a referida Ata, que assino com os demais membros abaixo nominados.

(assinado digitalmente)
Alan Nascimento
Coordenador
Mat. nº 160994-7 C

(assinado digitalmente)
Bruno Costa Novo
Secretário
Mat. nº 216821-9 B

(assinado digitalmente)
Bruno Barroso
Membro
Mat. nº 249252-0 A C

(assinado digitalmente)
Leonardo Cavalcanti
Membro
Mat. nº 179561-9 B

(assinado digitalmente)
Wellington Guimarães
Membro
Mat. nº 215.468-4 A

(assinado digitalmente)
Claudinei Soares
Membro
Mat. nº 216.006-4 A

(assinado digitalmente)
Marcos Souza
Membro
Mat. nº 249.152-4 A

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/10/2022 14:05:29
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 26/10/2022 23:28:31

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/10/2022 12:38:17
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 26/10/2022 12:46:57
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/10/2022 13:00:09
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/10/2022 13:16:40
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 26/10/2022 13:28:02

Documento assinado eletronicamente 218774/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJE4Nzco



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

Processo: **2023.A.00259**
Destino: **DIRAF / PRESI**
Assunto: **Relatório de Investimentos – Dezembro/2022**
Data: **13/01/2023**

RELATÓRIO Nº. 001 / 2023 - COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **dezembro/2022**, destacando:

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (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 15);
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 16 a 18);
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (páginas 19 a 20);
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (páginas 21 a 22);
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (páginas 23 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) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 39);
- 14) Relatório de Riscos da Carteira (páginas 40 a 51);
- 15) Parecer do Comitê de Investimentos (página 52).



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

Brasil: Copom mantém a Selic em 13,75% ao ano.

Mundo: Banco Central Europeu anunciou alta de 0,5 p.p. da taxa de juros.

O Banco Central manteve a taxa básica de juros em 13,75% ao ano. Na ata da reunião, foi mantida a preocupação com o ambiente externo, destacando o crescimento global abaixo do potencial em 2023, a normalização nas cadeiras de suprimentos e o processo de normalização da política monetária nos países desenvolvidos em direção às taxas restritivas e elevadas por período prolongado. Internamente, o Copom avaliou que os indicadores de atividade corroboram um cenário de desaceleração do crescimento, inclusive considerando um ritmo menor de recuperação no mercado de trabalho. O Comitê reforçou que, apesar da queda recente, a inflação ao consumidor continua elevada e possui riscos tanto altistas quanto baixistas. Talvez o debate mais relevante para o contexto atual foi sobre os impactos dos diferentes cenários fiscais sobre a inflação. Nesse sentido, o comitê avaliou que mudanças em políticas parafiscais ou a reversão de reformas estruturais que levem a uma alocação menos eficiente de recursos podem reduzir a potência da política monetária. Diante dessa análise, o Banco Central salientou que, em um ambiente de baixo grau de ociosidade, estímulos fiscais tendem a ter um impacto maior sobre a trajetória de inflação do que impactos positivos sobre a atividade econômica. No entanto, o momento ainda é de elevado grau de incerteza sobre o cenário fiscal prospectivo, requerendo serenidade na avaliação dos riscos. Avaliamos que o Banco Central deverá manter a taxa de juros estável até o terceiro trimestre de 2023, quando terá espaço para iniciar um ciclo moderado de cortes.

O PIB do 3º trimestre avançou 0,4% na comparação com o trimestre anterior. Na comparação trimestral, pela ótica da oferta, houve crescimento de dois grandes setores. O maior destaque foi o setor de serviços, com maiores contribuições positivas de outros serviços (1,4%), setor que contempla alojamento, alimentação, educação e saúde privados, e foi beneficiado pelos estímulos de renda – e administração pública (1,1%), beneficiado pelo retorno completo de serviços presenciais. No setor, a única contribuição negativa veio de comércio (-0,1%), impactado pelo processo de substituição do consumo entre bens e serviços. Outra contribuição positiva foi proveniente da indústria, com maiores destaques da construção civil (1,1%) e da indústria de transformação (0,1%). Por sua vez, a agropecuária teve recuo de 0,9% na margem. Pela ótica da demanda, o maior destaque foi o consumo das famílias (1,0%), seguido pelo surpreendente desempenho da formação bruta de capital fixo (2,8%), impactada pela construção civil e pelo desenvolvimento de softwares, segundo o IBGE. O desempenho líquido do setor externo foi negativo, com alta de exportações (3,6%) menor do que de

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJJwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

importações (5,8%). A abertura do PIB confirmou o maior consumo de bens e serviços pelas famílias, beneficiado pela demanda reprimida de serviços presenciais e sancionado por uma renda disponível maior. Na nossa visão, o último trimestre de 2022 deve ter mostrado queda da atividade, devido aos efeitos do aperto monetário e ao esgotamento de medidas pontuais sobre a renda das famílias.

Em dezembro, a prévia da inflação ao consumidor (IPCA-15) apresentou alta de 0,52%. Com isso, o índice fechou 2022 com elevação de 5,9%, desacelerando na variação acumulada em 12 meses em relação ao mês anterior (6,2%). O grupo com maior variação positiva foi mais uma vez Vestuário (1,16%). O IPCA-15 de dezembro ainda foi impactado pelas promoções da Black Friday, tal como observado no IPCA de novembro. Dessa forma, itens como Perfume (-4,2%) e Aparelho telefônico (-1,5%) ficaram entre as principais contribuições baixistas para o resultado. No entanto, a maior parte da surpresa baixista, em relação às projeções, ocorreu nos preços de serviços, como em Passagem Aérea (0,47%). Itens ligados a serviços subjacentes também desaceleraram, como Condomínio (-0,51%) e Aluguel residencial (0,35%), trazendo uma perspectiva baixista para o resultado fechado do IPCA de 2022. Com relação aos núcleos, que são métricas que excluem ou suavizam itens voláteis, a média anualizada de três meses com ajuste sazonal também arrefeceu, passando de uma alta de 6,3% para outra de 5,6%. Esse resultado reforça o alívio em curso da inflação, apesar de o núcleo de serviços e bens semiduráveis seguirem ainda pressionados e distantes das metas de inflação na variação acumulada em 12 meses (7,6% e 15,9%, respectivamente). Na margem, o núcleo de serviços subjacentes desacelerou de 6,9% para 5,4%, na média anualizada de três meses com ajuste sazonal, enquanto bens semiduráveis recuou de 14,4% para 12,4%. Nossa expectativa é que o processo de desinflação continue nos próximos meses.

No cenário internacional, há sinais de desaceleração da atividade econômica nos EUA. Em novembro, as vendas no varejo recuaram 0,6% na margem em termos nominais. O núcleo do indicador de vendas (que exclui automóveis, gasolina e materiais de construção) apresentou queda de 0,2% no mês. O resultado pode ser explicado parcialmente pelo processo de substituição do consumo entre bens e serviços e pela antecipação de compras de final de ano para outubro, o que aumentou a base de comparação para esse mês. Em direção similar ao comércio, a produção industrial recuou 0,2% em novembro. Em relação à indústria de transformação, houve retração de 0,6%, após crescimento médio de 0,2% nos últimos três meses. De modo geral, além do processo de substituição do consumo entre bens e serviços, o aumento do custo de vida e o aperto da taxa de juros também contribuem para uma desaceleração do consumo das famílias.

O Banco Central Europeu (BCE) avançou no processo de normalização da política monetária, anunciando alta de 0,50 p.p. da taxa de juros. Com isso, a taxa de juros aplicável às operações de

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROS em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

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

e valide o código: MJJwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

refinanciamento e as taxas de juros aplicáveis à facilidade permanente de liquidez e de depósito subiram para, respectivamente, 2,50%, 2,75% e 2,00% a.a. Somado a isso, o Conselho do BCE decidiu que, a partir de março de 2023, a carteira do programa de compra de ativos diminuirá a um ritmo de € 15 bilhões até ao final do segundo trimestre de 2023. Apesar de ter reduzido o ritmo das altas (de 0,75 para 0,50 p.p.), a autoridade monetária europeia trouxe um tom duro em relação à inflação, destacando que as taxas de juros ainda terão que subir de forma significativa para assegurar o retorno da inflação à meta de 2% a médio prazo. Em sua revisão de projeções, mesmo em 2025, a inflação segue acima dessa meta (2,3%), reforçando a sinalização de que o ciclo de alta de juros deve se estender nos próximos meses. Nossa expectativa é que os juros serão elevados em 0,50 p.p. em fevereiro e, a depender da evolução da atividade econômica e da inflação, esse ciclo será encerrado na passagem do primeiro para o segundo trimestre, levando a taxa de juros a pelo menos 3,0% a.a. Em reunião de política monetária, de forma surpreendente, o Banco Central do Japão optou por fazer um ajuste na forma como controla os juros, o que pode ser lido como o início da reversão da política ultra expansionista do país. Tendo como justificativa os riscos de má funcionalidade nos mercados, a autoridade monetária do país permitiu maior oscilação dos rendimentos dos títulos de 10 anos do governo do país. Assim, ampliou a banda de variação da curva, de 0,25 p.p. para 0,50 p.p. Essa mudança, por sua vez, se deu de forma independente da decisão da taxa de juros de referência para política monetária. Ainda assim, o mercado reagiu com queda dos mercados acionários e apreciação do iene, acreditando que ao longo de 2023 os ajustes seguirão na direção de uma política monetária mais restritiva. De fato, a inflação ao consumidor segue acelerando, chegando a 3,7% em novembro, na comparação interanual. Os núcleos, excluindo alimentos e energia, também continuam subindo, com alta de 2,8%. (Fonte: BRAM – Síntese Mensal – Dezembro/2022).

Perspectivas Renda Fixa

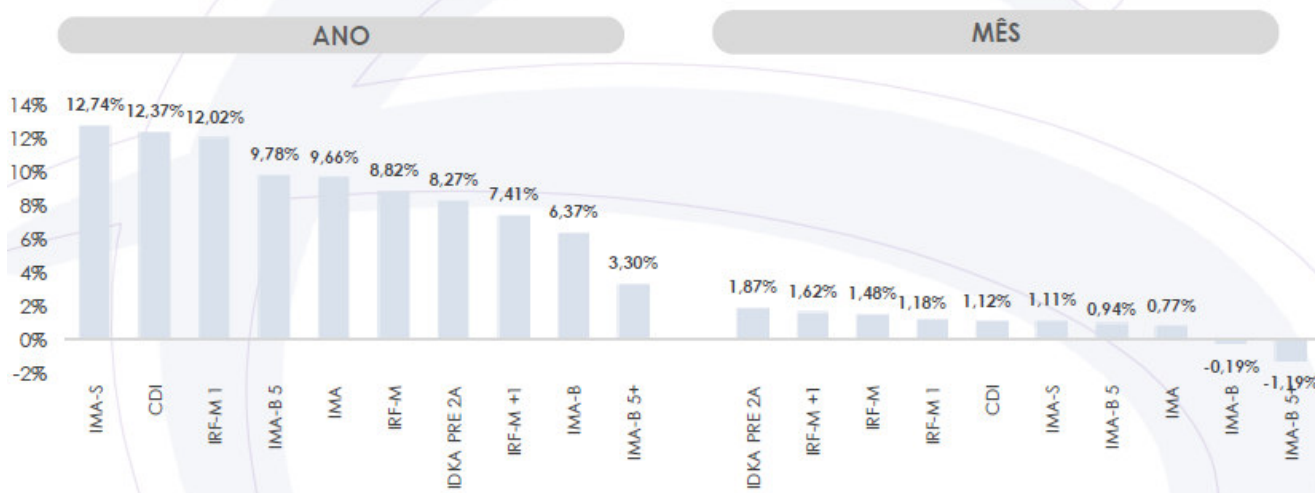
O ciclo inflacionário parece ter alcançado seu pico. O aperto monetário se encaminha para o estágio final e, por consequência, crescem as discussões sobre um possível corte de juros para frente. No mundo, existem evidências de queda da inflação em bens industrializados devido ao rebalanceamento da demanda dos consumidores entre bens e serviços e a melhora da oferta. **Entretanto, o nível de taxa deve se manter em um patamar superior por um período prolongado**, destaque para os Estados Unidos, onde a curva de 2 anos subiu 12 bps e de 10 anos 27 bps. Adicionalmente, os bancos centrais desenvolvidos sinalizaram uma redução do passo de aumento de juros, mas ainda demonstram elevada preocupação com o ciclo inflacionário. Por fim, a China, que declarou o fim da política de Covid Zero, tem dados de atividade mais fracos e preocupa com relação a uma recuperação.



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

Enquanto as taxas de juros subiam nos países desenvolvidos, permaneceram praticamente inalteradas no emergentes. O ambiente de desinflação e menor crescimento no mundo abre espaço para juros menores. Entretanto, no Brasil, as incertezas com relação ao novo governo têm promovido oscilações superiores aos pares brasileiros. O comportamento das curvas foi distinto, onde as taxas curtas nominais subiram, e as longas cederam. Do lado indexado à inflação, esse movimento foi inverso, taxas curtas cederam e longas subiram. Ao considerar os fatores globais descritos acima, ainda vê-se espaço para cortes de juros em 2023 levando nossa taxa básica para 11,5%. Do lado inflacionário, temos um número maior, devido à volta dos impostos sobre os combustíveis, levando o IPCA, índice de inflação do IBGE para 5,1%. Nesse mês, os índices da Anbima obtiveram desempenho positivo e, em sua maioria, acima do CDI. Do lado negativo, o IMA B 5 sofreu e terminou o ano com apenas 3,3% de resultado. O Destaque positivo foi para o IDA DI, índice de debêntures da Anbima, com desempenho de 117% do CDI no ano e o IMA S, que é uma carteira de LFTs, e rendeu 102% do CDI.

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA FIXA



Fonte: Carta do Gestor Janeiro/2023 – BRAM.

Perspectivas Renda Variável

Dezembro foi marcado pela maturação das políticas de aperto monetário no mundo e, depois de 2 meses seguidos de retornos positivos, por uma nova pressão negativa nos mercados acionários. O aumento nas taxas de juros no mundo em reação à inflação mais alta dos últimos 40 anos foi o maior vento contrário às ações em 2022, mas a sensação de que já entramos no período de queda da inflação e que as estimativas de taxas de juros futuras se estabilizaram nos últimos meses melhora significativamente o balanço de riscos para 2023. Adicionalmente, a reabertura da China colabora para estabilizar as expectativas de desaceleração da atividade no mundo. **Já no Brasil, as dúvidas em torno**

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MJJwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

do fiscal e a elevação dos juros futuros pressionaram as ações locais, em especial as Small Caps, que são mais sensíveis a movimentos como esse.

Assim, o S&P 500 teve queda de -5,90% e o Ibovespa de -2,45%. Estes índices acumulam desvalorização no ano de -19,44% e valorização de 4,69%, respectivamente e em moeda original.

Apesar dos preços atrativos, a gestão continua adotando cautela no curto prazo em função das incertezas locais. No médio e longo prazos, os gestores acreditam que a possibilidade de corte de juros, mesmo em menor intensidade que previam, pode proporcionar bons momentos para os ativos brasileiros. Neste contexto, segue a visão de adotar portfólios diversificados e de maior seletividade nas posições, mantendo o foco em empresas com qualidade no seu crescimento e múltiplos razoáveis.

A visão é construtiva para o médio prazo, devido à capacidade e experiência das empresas listadas em continuar apresentando resultados positivos mesmo em momentos mais desafiadores.

Sobre a performance setorial, a redução da expectativa queda da SELIC para 2023 foi positiva para o setor de Serviços Financeiros, além disso o cenário mais positivo para China continuou influenciando positivamente o setor de Mineração Siderurgia. Por outro lado, setores dependentes do crescimento do PIB ou impactados pela expectativa de juros mais altos foram destaques negativos, como Logística, Transportes Infraestrutura e Educação.

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA VARIÁVEL

	DEZEMBRO	2022	12 MESES	24 MESES	36 MESES
S&P 500 USD	-5,90%	-19,44%	-19,44%	2,22%	18,84%
MSCI WORLD USD	-4,34%	-19,46%	-19,46%	-3,25%	10,36%
IDIV	-1,61%	12,65%	12,65%	5,43%	4,37%
IBOVESPA	-2,45%	4,69%	4,69%	-7,80%	-5,11%
SMALL CAPS	-3,01%	-15,05%	-15,05%	-28,81%	-29,28%
IBRX100	-2,63%	4,02%	4,02%	-7,61%	-4,37%

Fonte: Carta do Gestor Janeiro/2023 – BRAM.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJJwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

2.1. SALDOS E PERFORMANCE RENDA FIXA

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/11/2022	30/12/2022	out/22	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB PREVID TP VII	R\$ 7.798.352,18	R\$ 7.885.247,87	1,0033	1,0022	1,1142	3,1522%	13,9763%	13,9763%	
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 54.472.245,29	R\$ 55.189.263,72	1,8900	(0,5200)	1,3200	2,6981%	8,7100%	8,7100%	
SAFRA SOBERANO REGIM PROP DI	R\$ 176.971.862,48	R\$ 78.858.235,25	1,0200	1,0000	1,1200	3,1729%	8,8120%	NC	
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 239.242.459,95	R\$ 141.932.746,84							
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 17.105,99	R\$ 17.288,85	0,9800	0,9500	1,0700	3,0301%	11,7918%	11,7918%	
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 2.660.249,56	R\$ 211.823.869,28	1,0700	1,0600	1,1700	3,3364%	13,0000%	13,0000%	
CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP	R\$ 115.259.922,64	R\$ 92.331.233,75	1,0322	1,0381	1,1497	3,2546%	9,8632%	NC	
BB PREVID RF PERFIL	R\$ 42.876.900,26	R\$ -	1,0391	1,0221	1,1224	3,2175%	9,7691%	NC	
ICATU VANGUARDA FIRF PLUS LP	R\$ 108.352.439,91	R\$ 109.587.609,85	1,0600	0,9500	1,1400	3,1831%	8,8333%	NC	
ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 102.463.090,06	R\$ 3.542.275,02	1,0300	1,0100	1,1000	3,1730%	8,7690%	NC	
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 371.629.708,42	R\$ 417.302.276,75							
CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE	R\$ 939.371,39	R\$ 150.000.000,00	-	-	-	0,0000%	NC	NC	
TOTAL art. 7º, inciso IV	R\$ 939.371,39	R\$ 150.000.000,00							
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 119.500.510,90	R\$ 120.910.991,78	1,1132	1,0800	1,1803	3,4116%	13,4878%	13,4878%	
ITAU HIGH GRADE RF DP FIC FI	R\$ 145.463.980,25	R\$ 147.168.816,77	1,1200	1,1500	1,1700	3,4796%	13,4600%	13,4600%	
BTG PACTUAL CRED CORP FIC FI RF CP	R\$ 97.613.509,72	R\$ 98.780.559,63	1,1500	1,1100	1,2000	3,5000%	14,2400%	14,2400%	
MAG CRED PRIV FI RF LP	R\$ 61.737.702,93	R\$ 62.490.499,08	1,1500	1,0900	1,2200	3,5000%	13,6100%	13,6100%	
PORTO SEGURO FI REFER DI CRED PRIV	R\$ 145.075.143,47	R\$ 146.779.351,67	1,0900	1,0914	1,1218	3,3397%	12,2644%	NC	
BNP PARIBAS MATCH DI FI RF REF CP	R\$ 71.970.030,75	R\$ 72.803.692,52	1,0616	1,0684	1,1583	3,3244%	8,0287%	NC	
RIO BRAVO CREDITO PRIVADO FI RF	R\$ 12.283.397,93	R\$ 12.431.340,24	1,1100	1,0600	1,2000	3,4079%	7,1648%	NC	
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 653.644.275,95	R\$ 661.365.251,69							
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 1.265.455.815,71	R\$ 1.370.600.275,28							

Quadro 1.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJJwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

2.2 SALDOS E PERFORMANCE RENDA VARIÁVEL

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2022	30/12/2022	out/22	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 68.424.189,26	R\$ 66.723.073,47	5,5800	(4,9400)	(2,4900)	-2,1347%	-2,0000%	-2,0000%
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 71.638.184,39	R\$ 70.345.239,26	8,1900	(9,2400)	(1,8000)	-3,5742%	-8,0000%	-8,0000%
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 100.748.146,17	R\$ 98.253.934,42	3,6084	(3,0006)	(2,4756)	-1,9884%	-3,4702%	-3,4702%
BB AÇÕES SELEÇÃO FATOR FIC FI	R\$ 51.078.076,69	R\$ 49.767.266,24	4,3609	(4,0031)	(2,5662)	-2,3877%	-0,7549%	-0,7549%
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 115.281.869,23	R\$ 112.267.636,26	8,4300	(10,6400)	(2,6100)	-5,6359%	-8,2500%	-8,2500%
BRASIL CAPITAL RP INSTIT FIC AÇÕES	R\$ 39.342.326,94	R\$ 38.252.758,52	7,4900	(5,4300)	(2,7700)	-1,1625%	-6,9600%	-6,9600%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 190.578.765,77	R\$ 184.740.124,14	7,7800	(8,0900)	(3,0600)	-3,9707%	-4,6700%	-4,6700%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANT	R\$ 12.607.014,45	R\$ 12.294.469,00	5,7746	(3,8792)	(2,4791)	-0,8491%	2,4732%	2,4732%
DAYCOVAL IBOVSPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.736.327,27	R\$ 18.352.468,46	6,7858	(4,5456)	(2,0505)	-0,1584%	6,4358%	6,4358%
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 82.875.492,23	R\$ 80.846.135,32	5,2100	(2,1600)	(2,4500)	0,4155%	5,3400%	5,3400%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 132.878.256,90	R\$ 93.874.541,89	10,6000	(8,5200)	1,8000	2,9981%	5,1600%	5,1600%
ITAU SMALL CAPS VALUATION	R\$ 71.031.977,10	R\$ 69.154.719,11	5,7600	(9,3300)	(2,6400)	-6,6390%	-9,4500%	-9,4500%
OCCAM FIC FIA	R\$ 113.095.070,38	R\$ 110.084.085,82	6,7500	(5,2600)	(2,6600)	-1,5552%	4,5200%	4,5200%
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 98.012.441,82	R\$ 93.214.497,15	8,3500	(8,8700)	(4,9000)	-6,0989%	-4,5600%	-4,5600%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 61.021.077,72	R\$ 59.515.970,30	7,7010	(8,3162)	(2,4665)	-3,6911%	10,4589%	10,4589%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 36.401.483,54	R\$ 35.227.121,75	5,5400	(6,9900)	(3,2300)	-5,0079%	0,1800%	0,1800%
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 41.983.858,04	R\$ 41.422.147,59	6,3800	(2,2300)	(1,3400)	2,6140%	12,4916%	NC
TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 4.885.507,22	R\$ 4.750.832,68	9,2500	(1,1000)	(2,7600)	5,0661%	16,3643%	NC
TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 63.107.697,99	R\$ 60.100.090,58	11,1400	(10,2394)	(4,7616)	-4,9902%	13,2852%	NC
4UM SMALL CAPS FIA	R\$ 40.403.117,17	R\$ 39.787.362,84	7,8100	(13,6400)	(1,5200)	-8,3105%	-11,8400%	-11,8400%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	R\$ 4.242.524,53	R\$ 4.182.085,85	5,3200	(6,0500)	(1,4200)	-2,4569%	-4,3328%	NC
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 41.347.694,94	R\$ 40.039.781,67	5,4100	(7,3800)	(3,1700)	-5,4642%	-1,7593%	NC
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 14.448.765,99	R\$ 14.109.109,63	5,3300	(6,6300)	(2,3500)	-3,9645%	-6,0569%	NC
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 1.474.169.865,74	R\$ 1.397.305.451,95						
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.474.169.865,74	R\$ 1.397.305.451,95						

Quadro 2.

2.3 SALDOS E PERFORMANCE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2022	30/12/2022	out/22	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 21.159.438,21	R\$ 20.979.443,86	1,6470	7,4922	(0,8506)	8,3332%	-19,2489%	-19,2489%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 32.241.790,80	R\$ 32.447.139,23	(0,2295)	6,7219	0,6369	7,1551%	-21,3112%	-21,3112%
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 13.796.522,63	R\$ 12.838.980,43	(1,7385)	(5,3720)	(6,9405)	-13,4706%	-62,3475%	-62,3475%
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 45.771.735,48	R\$ 44.790.174,49	3,6053	7,1402	(2,1445)	8,6225%	-25,7865%	-25,7865%
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 25.010.046,68	R\$ 25.059.710,90	1,7600	8,1600	0,2000	10,2837%	-22,4700%	-22,4700%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exte	R\$ 137.979.533,80	R\$ 136.115.448,91						
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 59.530.145,18	R\$ 56.680.008,07	4,4106	6,4083	(4,7877)	5,7823%	-25,1474%	-25,1474%
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 44.965.318,06	R\$ 42.866.060,36	2,3200	6,5500	(4,6700)	3,9306%	-30,3900%	-30,3900%
ITAU BDR NIVEL I AÇÕES FIC	R\$ 37.117.636,77	R\$ 35.734.854,74	6,5300	4,3600	(3,7300)	7,0279%	-11,7278%	NC
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 141.613.100,01	R\$ 135.280.923,17						
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 279.592.633,81	R\$ 271.396.372,08						

Quadro 3.



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

2.4 SALDOS E PERFORMANCE – FUNDOS ESTRUTURADOS

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/11/2022	30/12/2022	out/22	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES	
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 30.526.215,49	R\$ 29.040.957,02	8,8400	6,2000	(4,8700)	9,9589%	-8,0003%	NC	
FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV FIM	R\$ 15.540.161,04	R\$ 15.383.696,84	(3,2925)	(0,0728)	(1,0452)	-4,3730%	2,8529%	2,8529%	
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ 16.648.298,98	R\$ 17.081.845,43	1,4485	(0,0845)	2,5661	3,9638%	0,7602%	NC	
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MM	R\$ 15.342.706,86	R\$ 15.325.287,61	2,1100	(0,7400)	(0,1100)	1,2429%	2,3500%	2,3500%	
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$ 29.648.413,38	R\$ 30.085.990,02	0,4900	(1,1000)	1,4800	0,8555%	1,1883%	NC	
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MM	R\$ 10.343.379,54	R\$ 10.287.728,13	(0,3900)	(0,7700)	(0,5400)	-1,6907%	2,9700%	2,9700%	
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 118.049.175,29	R\$ 117.205.505,05							
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 35.256.952,00	R\$ 35.218.329,99	(0,1000)	(0,1000)	(0,1100)	-0,3097%	57,8100%	57,8100%	
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 12.361.498,37	R\$ 19.233.118,99	0,3000	(1,7800)	(0,8500)	-2,3227%	5,8000%	5,8000%	
CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$ 998.994,63	R\$ 1.112.237,95	11,2000	13,8100	(0,8400)	25,4936%	29,0005%	NC	
KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$ 16.223.398,60	R\$ 15.993.362,43	(1,4455)	(2,1002)	(1,4179)	-4,8834%	-13,4686%	NC	
TOTAL art. 10º, inciso II	R\$ 64.840.843,60	R\$ 71.557.049,36							
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 182.890.018,89	R\$ 188.762.554,41							
TOTAL GERAL	R\$ 3.202.108.334,15	R\$ 3.228.064.653,72							
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 220.387,29	R\$ -							
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ 20.000.000,00	R\$ -							
TOTAL RECURSOS	R\$ 3.222.328.721,44	R\$ 3.228.064.653,72							

Quadro 4.

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.

Nota 2: As movimentações tiveram como base a **Ata de reunião COMIV nº. 194/2022**, devidamente autorizadas pela Diretoria através de Despacho DIRAF de 23/12/2022 **a) Novos Recursos:** Aplicar os recursos no fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90).; **b) Demais Recursos:** migrar os recursos aplicados nos fundos: BB PREVID RF PERFIL (13.077.418/0001-49) todo o valor aplicado, R\$ 50 MM do fundo CAIXA FI BRASIL REF DI LP (03.737.206/0001-97), R\$ 50 MM do fundo ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LP (05.755.769/0001-33), R\$ 100 MM do fundo Safra Soberano (10.347.195/0001-02) e ITAU SOBERANO SIMPLES FIC (06.175.696/0001-73) para o fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90).

Nota 3: Realizada a integralização de 117.21427 cotas referente a 5ª Chamada de Capital do fundo VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIPM CLA.

Nota 4: Registrar a Aquisição de Títulos Públicos Federais no volume de R\$ R\$ 294.989.969,45 (duzentos e noventa e quatro milhões, novecentos e oitenta e nove mil, novecentos e sessenta e nove reais e quarenta e cinco centavos) no mês de dezembro/2022. Foram utilizados recursos dos fundos BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM, BB PREVID RF PERFIL e CAIXA FI BRASIL REF DI LP, conforme programado pelo Comitê.



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

2.5 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

INSTITUIÇÃO	out/22	nov/22	dez/22
BRASESCO	R\$ 405.486.142,44	R\$ 118.898.596,17	R\$ 474.108.794,39
BTG	R\$ 380.509.185,88	R\$ 366.336.941,35	R\$ 367.013.089,77
ITAÚ	R\$ 504.413.012,58	R\$ 488.954.941,08	R\$ 349.475.207,53
BANCO DO BRASIL	R\$ 272.199.159,77	R\$ 283.191.058,69	R\$ 233.565.900,46
CAIXA	R\$ 189.422.024,18	R\$ 214.527.642,40	R\$ 192.280.508,74
ICATU	R\$ 192.039.530,22	R\$ 191.227.932,14	R\$ 190.433.745,17
SANTANDER	R\$ 179.294.892,08	R\$ 165.272.246,38	R\$ 165.701.166,27
PORTO	R\$ 143.508.846,93	R\$ 145.075.143,47	R\$ 146.779.351,67
VINCI	R\$ 147.241.914,32	R\$ 135.412.919,99	R\$ 129.553.856,85
SAFRA	R\$ 217.423.923,53	R\$ 221.937.180,54	R\$ 121.724.295,61
OCCAM	R\$ 119.368.119,19	R\$ 113.095.070,38	R\$ 110.084.085,82
BNP	R\$ 71.209.192,32	R\$ 71.970.030,75	R\$ 72.803.692,52
AZ QUEST	R\$ 78.933.164,53	R\$ 71.638.184,39	R\$ 70.345.239,26
RIO BRAVO	R\$ 68.013.610,66	R\$ 67.617.897,71	R\$ 68.130.346,00
ARX	R\$ 71.978.553,14	R\$ 68.424.189,26	R\$ 66.723.073,47
MONGERAL	R\$ 61.073.812,05	R\$ 61.737.702,93	R\$ 62.490.499,08
TARPON	R\$ 70.306.660,03	R\$ 63.107.697,99	R\$ 60.100.090,58
GUEPARDO	R\$ 66.555.986,42	R\$ 61.021.077,72	R\$ 59.515.970,30
TRÍGONO	R\$ 47.882.939,63	R\$ 46.869.365,26	R\$ 46.172.980,27
PLURAL	R\$ 44.887.947,85	R\$ 46.038.313,43	R\$ 45.286.119,66
4UM	R\$ 51.300.114,40	R\$ 44.645.641,70	R\$ 43.969.448,69
CONSTANCIA	R\$ 44.640.459,55	R\$ 41.347.694,94	R\$ 40.039.781,67
BRASIL CAPITAL	R\$ 41.602.177,47	R\$ 39.342.326,94	R\$ 38.252.758,52
SCHRODER	R\$ 23.123.398,94	R\$ 25.010.046,68	R\$ 25.059.710,90
DAYCOVAL	R\$ 19.628.554,70	R\$ 18.736.327,27	R\$ 18.352.468,46
INTRAG	R\$ 16.571.427,61	R\$ 16.223.398,60	R\$ 15.993.362,43
CLARITAS	R\$ 15.474.737,34	R\$ 14.448.765,99	R\$ 14.109.109,63
TOTAL	R\$ 3.544.089.487,76	R\$ 3.202.108.334,15	R\$ 3.228.064.653,72

Quadro 5.

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXEC DEZEMBRO/22

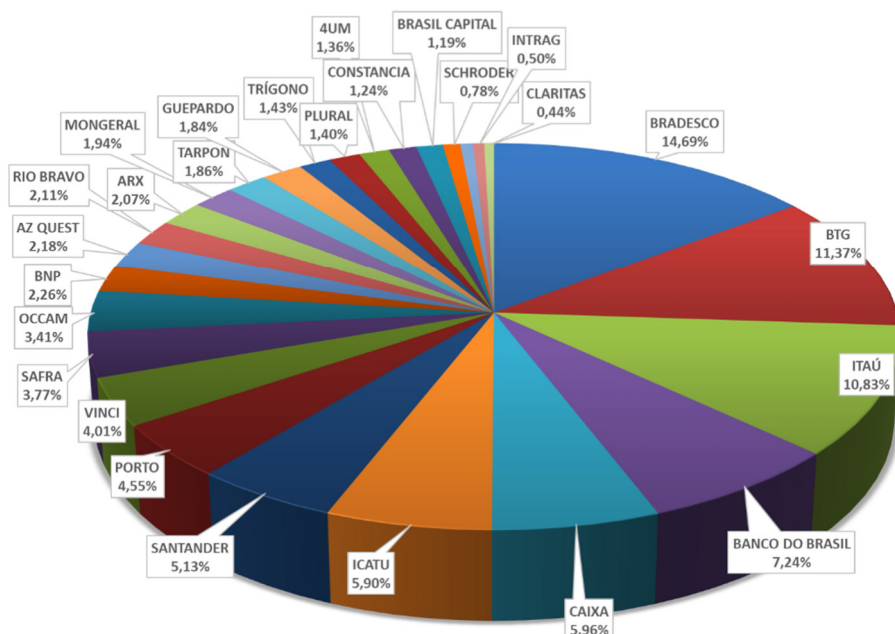


Gráfico 1.



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

2.6 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS

TPF (COMPRA - VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2022	30/12/2022	out/22	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 188.399.793,46	R\$ 190.562.337,87	1,1177	0,9367	1,1478	3,2364%	12,6397%	12,6397%
NTN-B (02/02/2022 - 15/05/23)	R\$ 51.946.486,85	R\$ 52.544.809,48	1,1216	0,9407	1,1518	3,2485%	11,3801%	NC
NTN-B (09/02/2022 - 15/05/23)	R\$ 51.789.726,39	R\$ 52.380.913,16	1,1114	0,9304	1,1415	3,2171%	11,0275%	NC
NTN-B (22/02/2022 - 15/05/23)	R\$ 103.091.718,49	R\$ 104.269.504,40	1,1123	0,9314	1,1425	3,2200%	10,5046%	NC
NTN-B (23/02/2022 - 15/05/23)	R\$ 103.033.358,95	R\$ 104.209.906,84	1,1117	0,9308	1,1419	3,2182%	10,4394%	NC
NTN-B (24/02/2022 - 15/05/23)	R\$ 103.025.106,60	R\$ 104.206.047,61	1,1161	0,9352	1,1463	3,2316%	10,4287%	NC
NTN-B (25/02/2022 - 15/05/23)	R\$ 102.884.483,28	R\$ 104.054.440,10	1,1070	0,9261	1,1372	3,2037%	10,2709%	NC
NTN-B (07/03/2022 - 15/05/23)	R\$ 50.979.495,74	R\$ 51.558.403,89	1,1054	0,9245	1,1356	3,1989%	9,3068%	NC
NTN-B (08/03/2022 - 15/05/23)	R\$ 101.902.724,50	R\$ 103.062.324,76	1,1078	0,9269	1,1379	3,2062%	9,2519%	NC
NTN-B (17/03/2022 - 15/05/23)	R\$ 50.599.249,47	R\$ 51.164.002,79	1,0860	0,9051	1,1161	3,1394%	8,4613%	NC
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 197.123.206,88	R\$ 199.404.567,22	1,1272	0,9462	1,1573	3,2655%	12,7665%	12,7665%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 204.008.660,73	R\$ 206.418.076,41	1,1509	0,9699	1,1810	3,3382%	13,0841%	13,0841%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 204.991.658,07	R\$ 207.364.114,55	1,1272	0,9462	1,1573	3,2655%	12,7666%	12,7666%
NTN-B (26/05/2022 - 15/08/2024)	R\$ 33.281.649,28	R\$ 33.648.565,17	1,0723	0,8914	1,1025	3,0975%	4,2832%	NC
NTN-B (26/05/2022 - 15/05/2025)	R\$ 33.267.536,75	R\$ 33.630.642,70	1,0613	0,8805	1,0915	3,0639%	4,8907%	NC
NTN-B (26/05/2022 - 15/08/2032)	R\$ 33.085.047,65	R\$ 33.445.898,26	1,0605	0,8797	1,0907	3,0615%	4,8618%	NC
NTN-B (27/05/2022 - 15/08/2024)	R\$ 100.788.286,82	R\$ 101.894.381,73	1,0673	0,8865	1,0974	3,0823%	4,9180%	NC
NTN-B (30/05/2022 - 15/08/2024)	R\$ 100.781.080,95	R\$ 101.885.973,68	1,0662	0,8853	1,0963	3,0788%	4,8863%	NC
NTN-B (31/05/2022 - 15/08/2024)	R\$ 100.878.449,39	R\$ 101.999.574,72	1,0812	0,9003	1,1114	3,1247%	5,0111%	NC
NTN-B (31/05/2022 - 15/08/2024)	R\$ 61.006.886,88	R\$ 61.685.621,82	1,0824	0,9015	1,1126	3,1284%	5,0211%	NC
NTN B (07/07/2022 - 15/05/2035)	R\$ 49.697.768,83	R\$ 50.250.486,19	1,0820	0,9011	1,1122	3,1272%	3,4545%	NC
NTN B (07/07/2022 - 15/08/2040)	R\$ 49.684.829,34	R\$ 50.237.592,31	1,0824	0,90%	1,11%	1,1028%	1,4240%	NC
NTN B (18/11/2022 - 15/08/2024)	R\$ 100.688.607,97	R\$ 101.861.879,36	-	0,6916	1,1652	1,8649%	1,8649%	NC
NTN B (24/11/2022 - 15/08/2024)	R\$ 100.639.494,77	R\$ 101.836.811,05	-	0,6410	1,1897	1,8383%	1,8383%	NC
NTN B (24/11/2022 - 15/08/2028)	R\$ 45.261.981,41	R\$ 45.775.424,95	-	0,5860	1,1344	1,7270%	1,7270%	NC
NTN B (24/11/2022 - 15/08/2032)	R\$ 45.261.748,94	R\$ 45.775.189,85	-	0,5860	1,1344	1,7270%	1,7270%	NC
LTN (24/11/2022 - 01/01/2025)	R\$ 10.025.802,57	R\$ 10.136.466,92	-	0,1998	1,1038	1,3058%	1,3058%	NC
NTN - B (15/12/2022 - 15/08/2032)	R\$ -	R\$ 30.258.796,76	-	0,0000	0,8065	0,8065%	0,8065%	NC
NTN - B (20/12/2022 - 15/08/2026)	R\$ -	R\$ 44.141.595,65	-	0,0000	0,7872	0,7872%	0,7872%	NC
TOTAL GERAL	R\$ 2.378.124.840,96	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).



Relatório de Investimentos – Dezembro/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	
	30/11/2022	30/12/2022
CVS - A	R\$ 868.527,15	R\$ 852.575,04
CVS - B	R\$ 5.618.930,30	R\$ 5.515.672,25
CVS - C	R\$ 112.667,10	R\$ 110.597,76
CVS - D	R\$ 616.190,52	R\$ 604.866,90
TOTAL	R\$ 7.216.315,07	R\$ 7.083.711,95

Quadro 8.

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

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJJwMUDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/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		% dos Recursos
	30/11/2022	30/12/2022	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 3.202.108.334,15	R\$ 3.228.064.653,72	55,8460%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.378.124.840,96	R\$ 2.479.664.350,20	42,8986%
TÍTULOS CVS	R\$ 7.216.315,07	R\$ 7.083.711,95	0,1225%
IMÓVEIS	R\$ 68.293.435,00	R\$ 65.484.778,63	1,1329%
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ 20.000.000,00	R\$ -	0,0000%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 220.387,29	R\$ -	0,0000%
TOTAL	R\$ 5.675.963.312,47	R\$ 5.780.297.494,50	100,00%

Quadro 11.



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

2.12 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS

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

Quadro 12.

2.13 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

1. Investimentos - Executivo

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

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

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

Quadro 13.

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



Relatório de Investimentos – Dezembro/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		VALORIZAÇÃO				
	30/11/2022	30/12/2022	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 98.510,13	R\$ 98.145,85	(1,0300)	(0,3700)	-0,5285%	7,8300%	7,8300%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 98.510,13	R\$ 98.145,85					
BB PREVID RF PERFIL	R\$ 1.235.166,69	R\$ -	1,0221	1,1224	4,3452%	9,7691%	NC
ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LP	R\$ 82.181,97	R\$ 83.118,81	0,9500	1,1400	4,3284%	8,8333%	NC
SAFRA SOBERANO RP DI FIC REF	R\$ 83.843,41	R\$ -	1,0000	1,1200	4,2872%	7,6814%	NC
CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP	R\$ 500.959,21	R\$ -	1,0381	1,1497	4,3957%	9,8632%	NC
BRABESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ -	R\$ 259.573,77	-	1,1700	1,1700%	1,1700%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 1.902.151,28	R\$ 342.692,58					
CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE	R\$ -	R\$ 540.275,98	-	-	0,0000%	0,0000%	NC
TOTAL art. 7º, inciso IV	R\$ -	R\$ 540.275,98					
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 2.236.339,00	R\$ 2.259.367,15	(0,3800)	1,0300	3,2153%	10,9500%	10,9500%
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 1.035.631,39	R\$ 1.048.013,22	1,1100	1,2000	4,8041%	14,2306%	NC
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 3.271.970,39	R\$ 3.307.380,37					
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 5.272.631,80	R\$ 4.288.494,78					

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO				
	30/11/2022	30/12/2022	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 477.099,35	R\$ 465.416,71	(2,1600)	(2,4500)	0,8975%	5,3400%	5,3400%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 1.079.428,06	R\$ 1.046.358,30	(8,0900)	(3,0600)	-4,2683%	-4,6700%	-4,6700%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT	R\$ 502.957,24	R\$ 490.488,23	(3,8792)	(2,4791)	-4,0369%	2,4732%	2,4732%
OCCAM FIC FIA	R\$ 2.007.908,01	R\$ 1.954.450,52	(5,2600)	(2,6600)	-1,6832%	4,5200%	4,5200%
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 105.106,17	R\$ 102.195,31	(5,4300)	(2,7700)	-1,0340%	-6,9600%	-6,9600%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 4.172.498,83	R\$ 4.058.909,07					
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 4.172.498,83	R\$ 4.058.909,07					

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO				
	30/11/2022	30/12/2022	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 1.240.782,71	R\$ 1.182.855,33	6,5500	(4,6700)	-3,2094%	-30,3900%	-30,3900%
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 1.240.782,71	R\$ 1.182.855,33					
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.240.782,71	R\$ 1.182.855,33					

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)				
	30/11/2022	30/12/2022	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 727.706,25	R\$ 692.705,53	5,9400	(4,8100)	0,1515%	-11,9200%	-11,9200%
ITAÚ MM SP500 BRL FIC	R\$ 157.793,15	R\$ 150.198,45	6,0600	(4,8100)	0,3006%	-11,9200%	-11,9200%
BTG PACTUAL S&P500 BRL FI MULTIMERCADO	R\$ 346.156,25	R\$ 329.313,96	6,2000	(4,8700)	4,4500%	-0,8495%	NC
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 1.231.655,65	R\$ 1.172.217,94					
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 1.231.655,65	R\$ 1.172.217,94					

TOTAL GERAL	R\$ 11.917.568,99	R\$ 10.702.477,12					
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 50.882,03					
VALORES EM TRANSITO	R\$ -	R\$ -					
TOTAL DOS RECURSOS	R\$ 11.917.568,99	R\$ 10.753.359,15					

Quadro 14.

Nota 1: As movimentações neste mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. 194/2022, devidamente autorizada pela Diretoria: **a) Novos Recursos:** aplicar no fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

90). **b) Recursos atuais:** Zerar posição nos fundos alocados em Renda Fixa (art. 7º III-a da Resolução CMN 4.963) nas instituições Caixa/BB/Safra/Icatu, migrando para o Bradesco DI Premium. Zerar posição no fundo Icatu Vanguarda Crédito Privado migrando para Bradesco DI Premium. Manter estudo para resgatar o montante de R\$ 900.000,00 a R\$ 1.000.000,00 milhão de reais aplicado em fundos de renda variável desde que somente cotas positivas, direcionando-os para o fundo Bradesco DI Premium ou compra de títulos públicos em que os juros estejam superiores a 6,00%. Tal estratégia busca cumprir a orientação do Estudo ALM 2023, que sugere como estratégia para a Carteira o aumento de recursos em Renda Fixa e a redução de posição em Renda Variável.

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2022	30/12/2022	out/22	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.710.828,93	R\$ 2.742.844,80	1,1509	0,9699	1,1810	3,3381%	13,0840%	13,0840%
NTN B (12/07/2022 - 15/05/2035)	R\$ 5.474.384,28	R\$ 5.536.311,06	1,1011	0,9201	1,1312	3,4090%	3,6676%	NC
NTN B (20/12/2022 - 15/08/2026)	R\$ -	R\$ 1.208.696,48	-	-	0,7872	0,7872%	0,7872%	NC
TOTAL GERAL	R\$ 8.185.213,21	R\$ 9.487.852,34						

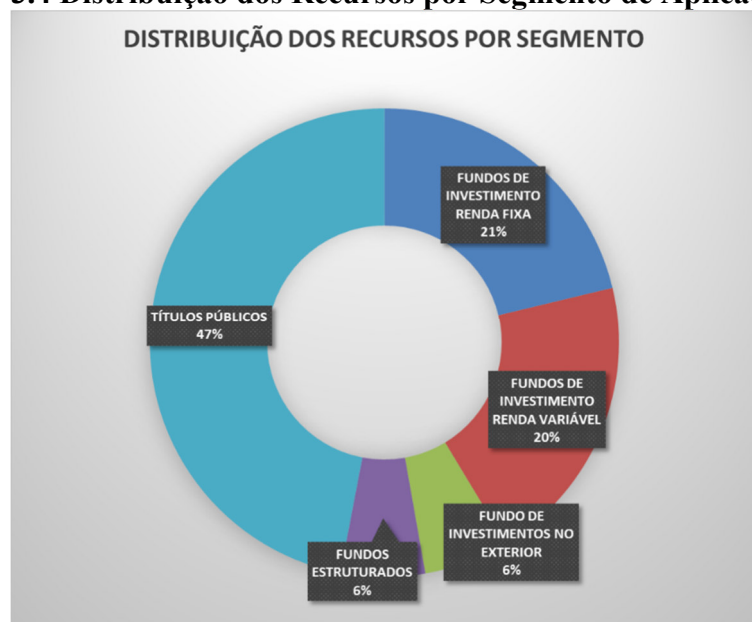
Quadro 15.

3.3 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	30/11/2022	30/12/2022
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 5.272.631,80	R\$ 4.288.494,78
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 4.172.498,83	R\$ 4.058.909,07
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.240.782,71	R\$ 1.182.855,33
FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 1.231.655,65	R\$ 1.172.217,94
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 8.185.213,21	R\$ 9.487.852,34
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 50.882,03
TOTAL	R\$ 20.102.782,20	R\$ 20.241.211,49

Quadro 16.

3.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação



Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJJwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

Gráfico 2.

3.5 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.



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

4.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos

FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)				
	30/11/2022	30/12/2022	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BRANCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 12.241.040,63	R\$ 52.803.126,41	1,0600	1,1700	3,3364%	13,0000%	13,0000%
BB PREVID RF PERFIL	R\$ 70.180.720,19	R\$ -	1,0221	1,1224	3,2175%	10,8267%	NC
SAFRA SOBERANO RP DI FIC REF	R\$ 1.803.681,81	R\$ -	1,0000	1,1200	3,1729%	7,6814%	NC
CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP	R\$ 8.532.318,51	R\$ -	1,0381	1,1497	3,2546%	9,8632%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 92.757.761,14	R\$ 52.803.126,41					
CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE	R\$ 150.918,68	R\$ 1.822.087,86	-	-	-	NC	NC
TOTAL art. 7º, inciso IV	R\$ 150.918,68	R\$ 1.822.087,86					
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 92.908.679,82	R\$ 54.625.214,27					
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)				
	30/11/2022	30/12/2022	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.240.288,14	R\$ 1.205.938,91	(5,4300)	(2,7700)	-1,1625%	-6,9600%	-6,9600%
BB AÇOES VALOR	R\$ 20.788.265,18	R\$ 20.273.612,19	(3,0006)	(2,4756)	-1,9884%	-3,4702%	-3,4702%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 9.231.306,09	R\$ 9.003.612,51	(8,3162)	(2,4665)	-3,6911%	3,7239%	NC
OCCAM FIC FIA	R\$ 6.193.489,09	R\$ 6.028.596,85	(5,2600)	(5,2600)	-4,1847%	-5,4864%	NC
TARPON GT INST FIC FIA	R\$ 7.143.558,77	R\$ 6.803.108,70	(10,2394)	(4,7616)	-4,9902%	7,9137%	NC
TRIGONO FLAGSHIP INST FI FIA	R\$ 6.953.112,18	R\$ 6.860.085,10	(2,2300)	(1,3400)	2,6140%	15,6668%	NC
TOTAL art. 8º, inciso I - RENDA VARIÁVEL	R\$ 51.550.019,45	R\$ 50.174.954,26					
FUNDO DE INVESTIMENTO - FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)				
	30/11/2022	30/12/2022	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 6.979.580,16	R\$ 6.643.881,00	5,9400	(4,8100)	9,5270%	-7,4700%	-2,4500%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 1.934.854,19	R\$ 1.840.713,51	6,2000	(4,8700)	9,9589%	-7,9957%	NC
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 8.914.434,35	R\$ 8.484.594,51					
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 390,08	R\$ 8.625.991,08					
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	R\$ -					
TOTAL RECURSOS	R\$ 153.373.523,70	R\$ 121.910.754,12					

Quadro 18.

Nota 1: As movimentações neste mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. 194/2022, devidamente autorizada pela Diretoria: **a) Novos Recursos:** Direcionar para o fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90). **b) Recursos atuais:** Zerar posição nos fundos alocados em Renda Fixa (art. 7º III-a da Resolução CMN 4.963) nas instituições **Caixa/BB/Safra/Icatu**, migrando para o Bradesco DI Premium. No entanto, por questões operacionais e considerando a existência de despesas no FPREV desses Poderes, cujos valores são inferiores ao resgate mínimo do fundo DI PREMIUM, qual seja, R\$ 200.000,00, a Coordenadoria Financeira fica autorizada a destinar parte do recurso de arrecadação previdenciária no fundo Bradesco Maxi Poder Público ou CDB Fácil Bradesco de acordo com a necessidade de cada folha de pagamento, facilitando, assim, a rotina de pagamentos



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

4.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –MPE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2022	30/12/2022	out/22	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (09/06/2022 - 15/08/2024)	R\$ 50.043.063,55	R\$ 50.592.855,55	1,0685	0,8876	1,0986	3,0858%	4,1744%	NC
NTN-B (12/07/22 - 15/05/35)	R\$ 19.906.851,92	R\$ 20.132.040,20	1,1011	0,9201	1,1312	3,1855%	3,6675%	NC
NTN - B (13/12/2022 - 15/05/2025)	R\$ -	R\$ 12.109.662,23	-	-	0,9139	0,9139%	0,9139%	NC
NTN B - (15/12/2022 - 15/08/2028)	R\$ -	R\$ 20.169.868,13	-	-	0,8625	0,8625%	0,8625%	NC
TOTAL GERAL	R\$ 69.949.915,48	R\$ 103.004.426,11						

Quadro 19.

4.3 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 20.



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)				
	30/11/2022	30/12/2022	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 34.503.006,69	R\$ 1.317.850,23	1,0600	1,1700	3,3364%	13,0000%	13,0000%
BB PREVID RF PERFIL	R\$ 258.201,95	R\$ -	1,0221	1,1224	3,2175%	10,8267%	NC
SAFRA SOBERANO RP DI FIC REF	R\$ 1.272.983,00	R\$ -	1,0000	1,1200	3,1729%	7,6814%	NC
CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP	R\$ 265.961,12	R\$ -	1,0381	1,1497	3,2546%	9,8632%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 36.300.152,76	R\$ 1.317.850,23					
CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE	R\$ 130.124,40	R\$ 1.527.841,16	-	-	0,0000%	NC	NC
TOTAL art. 7º, inciso IV	R\$ 130.124,40	R\$ 1.527.841,16					
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 36.430.277,16	R\$ 2.845.691,39					

FUNDOS DE AÇÕES	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)				
	30/11/2022	30/12/2022	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 833.979,85	R\$ 810.883,14	(5,4300)	(2,7700)	-1,1625%	-6,9600%	-6,9600%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 15.488,78	R\$ 15.104,79	(3,8792)	(2,4791)	-0,8491%	2,4732%	2,4732%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 2.845.817,64	R\$ 2.775.624,50	(8,3162)	(2,4665)	-3,6911%	3,7239%	2,9770%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 3.695.286,27	R\$ 3.601.612,43					

FUNDO ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)				
	30/11/2022	30/12/2022	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 3.480.901,75	R\$ 3.313.479,73	5,9400	(4,8100)	9,5270%	-11,9200%	-11,9200%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 1.675.022,64	R\$ 1.593.524,11	6,2000	(4,8700)	9,9589%	-7,9957%	NC
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 5.155.924,39	R\$ 4.907.003,84					

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 12.537,04	R\$ 27.013,93					
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	R\$ -					
TOTAL RECURSOS	R\$ 45.294.024,86	R\$ 11.381.321,59					

Quadro 21.

Nota 1: As movimentações neste mês com base na Ata de reunião COMIV nº. 194/2022, devidamente autorizada pela Diretoria: **a) Novos Recursos:** Direcionar para o fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90). **b) Recursos atuais:** Zerar posição nos fundos alocados em Renda Fixa (art. 7º III-a da Resolução CMN 4.963) nas instituições Caixa/BB/Safra/Icatu, migrando para o Bradesco DI Premium. No entanto, por questões operacionais e considerando a existência de despesas no FPREV desses Poderes, cujos valores são inferiores ao resgate mínimo do fundo DI PREMIUM, qual seja, R\$ 200.000,00, a Coordenadoria Financeira fica autorizada a destinar parte do recurso de arrecadação previdenciária no fundo Bradesco Maxi Poder Público ou CDB Fácil Bradesco de acordo com a necessidade de cada folha de pagamento, facilitando, assim, a rotina de pagamentos.



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

5.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –DPE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2022	30/12/2022	out/22	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN B (12/07/2022 - 15/05/2023)	R\$ 9.953.425,97	R\$ 10.066.020,11	1,1011	0,9201	1,1312	3,1855%	3,6675%	NC
NTN - B (13/12/2022 - 15/05/2025)	R\$ -	R\$ 35.319.848,17	-	-	0,9139	0,9139%	0,9139%	NC
TOTAL GERAL	R\$ 9.953.425,97	R\$ 45.385.868,28						

Quadro 22.

5.3 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 23.



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)				
	30/11/2022	30/12/2022	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 43.452.773,15	R\$ 79.314.948,83	1,0600	1,1700	3,3364%	13,0000%	13,0000%
CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP	R\$ 55.199.044,65	R\$ -	1,0381	1,1497	3,2546%	9,8632%	NC
BB PREVID RF PERFIL	R\$ 115.131.491,69	R\$ -	1,0221	1,1224	3,2175%	9,7691%	NC
SAFRA SOBERANO RP DI FIC REF	R\$ 2.049.756,17	R\$ -	1,0000	1,1200	3,1729%	7,6814%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 215.833.065,66	R\$ 79.314.948,83					
CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE	R\$ 4.402.567,48	R\$ 52.269.305,91	-	-	-	-	-
TOTAL art. 7º, inciso IV	R\$ 4.402.567,48	R\$ 52.269.305,91					
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 220.235.633,14	R\$ 131.584.254,74					

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)				
	30/11/2022	30/12/2022	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 2.707.175,89	R\$ 2.632.201,84	(5,4300)	(2,7700)	-1,1625%	-6,9600%	-6,9600%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 9.757.750,75	R\$ 9.515.842,52	(3,8792)	(2,4791)	-0,8491%	2,4732%	2,4732%
OCCAM FIC FIA	R\$ 1.105.017,79	R\$ 1.075.598,37	(5,2600)	(2,6600)	-1,5552%	-2,7991%	NC
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 1.240.546,73	R\$ 1.223.949,21	(2,2300)	(1,3400)	2,6140%	15,6668%	NC
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.281.439,27	R\$ 1.220.368,02	(10,2394)	(4,7616)	-4,9902%	7,9137%	NC
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 6.199.760,00	R\$ 6.046.840,63	(8,3162)	(2,4665)	-3,6911%	3,7239%	2,9391%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 4.775.186,87	R\$ 4.621.132,80	(6,9900)	(3,2300)	-5,0079%	0,1757%	NC
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 27.066.877,30	R\$ 26.335.933,39					

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)				
	30/11/2022	30/12/2022	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 25.779.245,96	R\$ 25.559.952,86	7,4922	(0,8506)	8,3332%	-19,2489%	-19,2489%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 25.779.245,96	R\$ 25.559.952,86					

FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)				
	30/11/2022	30/12/2022	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 18.569.384,65	R\$ 17.676.247,11	5,9400	(4,8100)	9,5270%	-11,9200%	-11,9200%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 18.569.384,65	R\$ 17.676.247,11					
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 48,32	R\$ 5.606.412,76					
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	R\$ -					
TOTAL	R\$ 291.651.189,37	R\$ 206.762.800,86					

Quadro 24.

Nota 1: As movimentações neste mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. 194/2022, devidamente autorizada pela Diretoria: **a) Novos Recursos:** Direcionar para o fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90). **b) Recursos atuais:** Zerar posição nos fundos alocados em Renda Fixa (art. 7º III-a da Resolução CMN 4.963) nas instituições Caixa/BB/Safra/Icatu, migrando para o Bradesco DI Premium. No entanto, por questões operacionais e considerando a existência de despesas no FPREV desses Poderes, cujos valores são inferiores ao resgate mínimo do fundo DI PREMIUM, qual seja, R\$ 200.000,00, a Coordenadoria Financeira fica autorizada a destinar parte do recurso de arrecadação previdenciária no fundo Bradesco Maxi Poder Público ou CDB Fácil Bradesco de acordo com a necessidade de cada folha de pagamento, facilitando, assim, a rotina de pagamentos.



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

6.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –TJAM/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/11/2022	30/12/2022	set/22	out/22	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (11/02/22 - 15/05/23)	R\$ 41.403.433,65	R\$ 41.880.812,18	0,2382	1,1228	0,9419	1,1530	3,2522%	11,0416%	NC
NTN-B (16/06/22 - 15/05/23)	R\$ 200.650.538,51	R\$ 202.994.954,02	0,2534	1,1382	0,9573	1,1684	3,2994%	4,4883%	NC
NTN-B (12/07/2022 - 15/05/2035)	R\$ 47.278.776,26	R\$ 47.813.598,46	0,2166	1,1011	0,9201	1,1312	3,1855%	3,6675%	NC
NTN -B (13/12/2022 - 15/05/2025)	R\$ -	R\$ 3.025.882,61	-	-	-	0,9139	0,9139%	0,9139%	NC
NTN - B (13/12/2022 - 15/05/2027)	R\$ -	R\$ 40.364.085,49	-	-	-	0,9073	0,9073%	0,9073%	NC
NTN - B (15/12/2022 - 15/08/2024)	R\$ -	R\$ 40.361.594,18	-	-	-	0,9011	0,9011%	0,9011%	NC
TOTAL GERAL	R\$ 289.332.748,43	R\$ 376.440.926,94							

Quadro 25

6.3 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

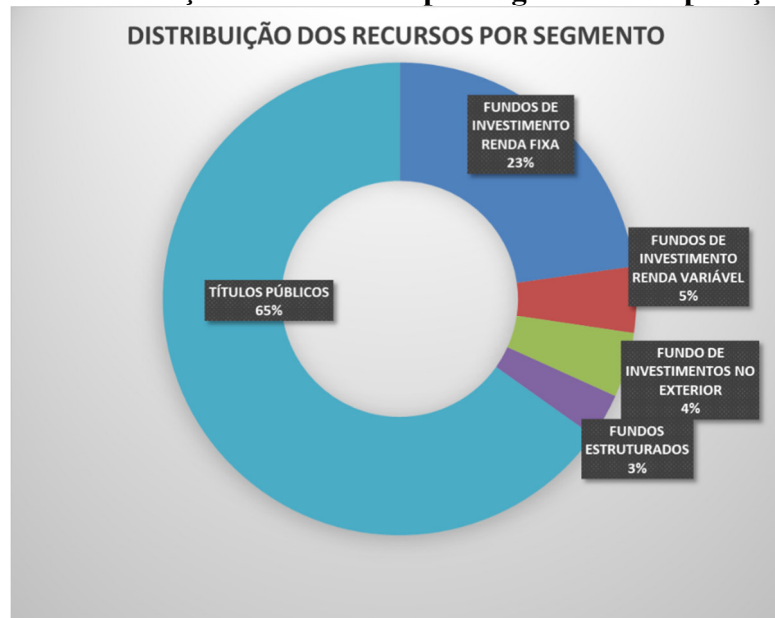


Gráfico 3.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJUwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/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 26.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJJwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/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		VALORIZAÇÃO (%)				
	30/11/2022	30/12/2022	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 16.819.418,23	R\$ 19.876.175,02	1,0600	1,1700	3,3364%	13,0000%	13,0000%
BB PREVID RF PERFIL	R\$ 59.923.733,07	R\$ -	1,0221	1,1224	3,2175%	9,7691%	NC
CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP	R\$ 28.789.358,87	R\$ -	1,0381	1,1497	3,2546%	9,8632%	NC
SAFRA SOBERANO RP DI FIC REF	R\$ 330.256,99	R\$ -	1,0000	1,1200	10,9247%	15,7718%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 105.862.767,16	R\$ 19.876.175,02					
CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE	R\$ 917.653,42	R\$ 26.514.993,31	-	-	0,0000%	0,0000%	NC
TOTAL art. 7º, inciso IV	R\$ 917.653,42	R\$ 26.514.993,31					
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 106.780.420,58	R\$ 46.391.168,33					

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)				
	30/11/2022	30/12/2022	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 731.376,61	R\$ 711.121,46	(5,4300)	(2,7700)	-1,1625%	-6,9600%	-6,9600%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT.	R\$ 9.757.750,75	R\$ 9.515.842,52	(3,8792)	(2,4791)	-0,8491%	2,4731%	2,4731%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.436.037,13	R\$ 1.400.616,74	(8,3162)	(2,4665)	-3,6911%	3,7239%	NC
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 889.871,53	R\$ 861.163,05	(6,9900)	(3,2300)	-5,0079%	3,5200%	6,2700%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 12.815.036,02	R\$ 12.488.743,77					

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)				
	30/11/2022	30/12/2022	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 493.043,82	R\$ 488.849,71	7,4922	(0,8506)	8,3332%	-19,2489%	-19,2489%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 493.043,82	R\$ 488.849,71					

FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)				
	30/11/2022	30/12/2022	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 3.464.563,21	R\$ 3.297.927,03	5,9400	(4,8100)	9,5270%	-11,9200%	-11,9200%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 3.464.563,21	R\$ 3.297.927,03					

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 510,87	R\$ 2.924.055,24					
VALORES EM TRANSITO	R\$ -	R\$ -					
TOTAL	R\$ 123.553.574,50	R\$ 65.590.744,08					

Quadro 27.

Nota 1: As movimentações neste mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. 194/2022, devidamente autorizada pela Diretoria: a) **Novos Recursos:** Direcionar para o fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90). b) Recursos atuais: Zerar posição nos fundos alocados em Renda Fixa (art. 7º III-a da Resolução CMN 4.963) nas instituições Caixa/BB/Safra/Icatu, migrando para o Bradesco DI Premium. No entanto, por questões operacionais e considerando a existência de despesas no FPREV desses Poderes, cujos valores são inferiores ao resgate mínimo do fundo DI PREMIUM, qual seja, R\$ 200.000,00, a Coordenadoria Financeira fica autorizada a destinar parte do recurso de arrecadação previdenciária no fundo Bradesco Maxi Poder Público ou CDB Fácil Bradesco de acordo com a necessidade de cada folha de pagamento, facilitando, assim, a rotina de pagamentos.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJJwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

7.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –TCE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2022	30/12/2022	out/22	nov/22	dez/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN B (12/07/2022 - 15/05/2035)	R\$ 16.920.824,14	R\$ 17.112.234,17	1,1011	0,9201	1,1312	3,1855%	3,6675%	NC
NTN - B (13/12/2022 - 15/05/2027)	R\$ -	R\$ 10.090.732,86	-	-	0,9073	0,9073%	0,9073%	NC
NTN - B (15/12/2022 - 15/08/2024)	R\$ -	R\$ 50.448.655,06	-	-	0,9011	0,9011%	0,9011%	NC
TOTAL GERAL	R\$ 16.920.824,14	R\$ 77.651.622,10						

Quadro 28

7.3 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

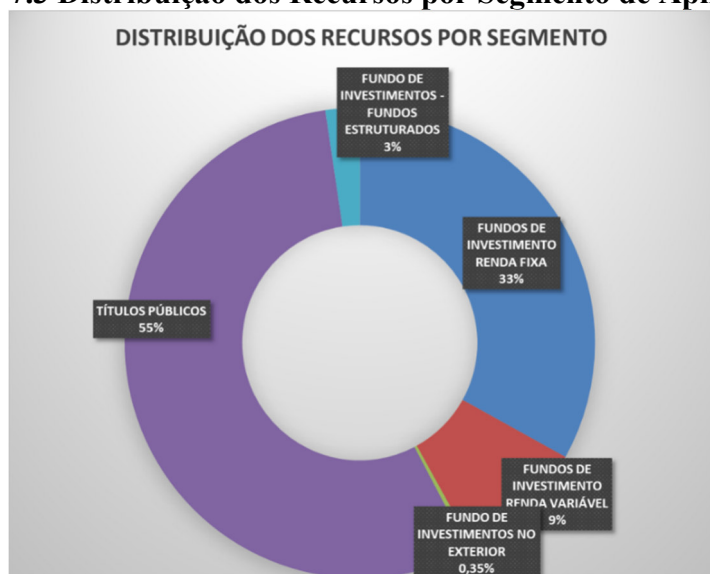


Gráfico 4.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJJwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

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 29.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MJUwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/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 30.

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.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MJJwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

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



Gráfico 5.

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

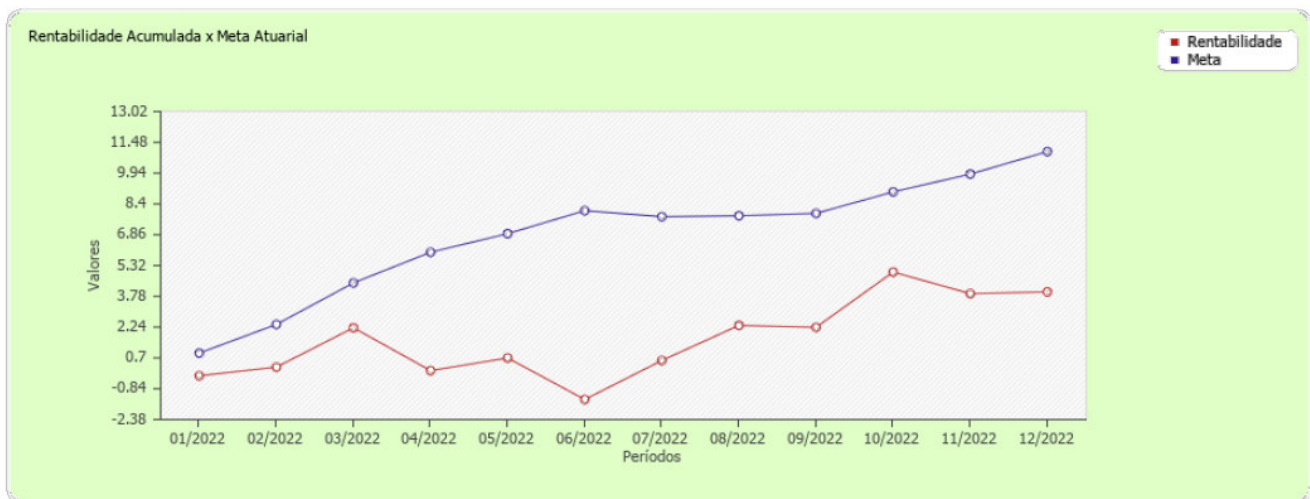


Gráfico 6.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MJJwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/11/2022	30/12/2022
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 488.517,12	R\$ 2.755.850,94
FUNDO BRADESCO RF - COMPREV	R\$ 10.399.578,94	R\$ 11.567.375,56
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 2.723,35	R\$ 5.056,68
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 12.746.107,47	R\$ 53.852,62
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 237.998,86	R\$ 237.999,46
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 351.830,77	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - COMPREV	R\$ 268,38	R\$ -
TOTAL	R\$ 24.227.024,89	R\$ 14.620.135,26

Quadro 31.

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	
	30/11/2022	30/12/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R\$ 4.874,89	R\$ 4.912.116,18
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R\$ 26.935,19	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ 24.644,93	R\$ 24.617,98
TOTAL	R\$ 56.455,01	R\$ 4.936.734,16

Quadro 32.

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	
	30/11/2022	30/12/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 145,57	R\$ 160,20
TOTAL	R\$ 145,57	R\$ 160,20

Quadro 33.



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2022	30/12/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 7.049,05	R\$ 3.342,72
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 2.075,62	R\$ 2.175,62
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 3.076,75	R\$ -
TOTAL	R\$ 12.201,42	R\$ 5.518,34

Quadro 34.

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2022	30/12/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.374.964,26	R\$ 1.090.332,03
CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE	R\$ 177.036,74	R\$ -
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 182,96	R\$ -
TOTAL	R\$ 1.552.183,96	R\$ 1.090.332,03

Quadro 35.

9.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2022	30/12/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ 14.080.633,88
CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE	R\$ 13.266.289,27	R\$ -
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 900.308,74	R\$ -
TOTAL	R\$ 14.166.598,01	R\$ 14.080.633,88

Quadro 36.

9.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2022	30/12/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ 1.618.817,12
CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE	R\$ 2.722.072,87	R\$ -
DISPONIBILIDADE COBERTURA TCE FFIN	R\$ 2.462.932,39	R\$ 5.884,33
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 132.000,00	R\$ -
TOTAL	R\$ 5.317.005,26	R\$ 1.624.701,45
TOTAL GERAL FFIN	R\$ 45.331.614,12	R\$ 36.358.215,32

Quadro 37.



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Evolução do Saldo de Taxa de Administração

DESCRIÇÃO	SALDOS		
	31/12/2021	31/11/2022	31/12/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.143,62	R\$ -	R\$ 961.974,54
CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE		R\$ -	R\$ 978,98
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 40.560.407,77	R\$ 24.771.401,43	R\$ 22.023.255,82
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 62.358,18	R\$ -
TOTAL PODER EXECUTIVO	R\$ 40.561.552,39	R\$ 24.833.759,61	R\$ 22.986.209,34
DESCRIÇÃO	SALDOS		
	31/12/2021	31/11/2022	31/12/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 35.718,27	R\$ -	R\$ -
TOTAL - ALE	R\$ 35.718,27	R\$ -	R\$ -
DESCRIÇÃO	SALDOS		
	31/12/2021	31/11/2022	31/12/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 61.970,46	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ -	R\$ -
TOTAL - TCE	R\$ 61.971,46	R\$ -	R\$ -
DESCRIÇÃO	SALDOS		
	31/12/2021	31/11/2022	31/12/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 605.835,00	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL TJ/AM	R\$ 605.835,00	R\$ -	R\$ -
DESCRIÇÃO	SALDOS		
	31/12/2021	31/11/2022	31/12/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 199.434,03	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL PGJ/AM	R\$ 199.434,03	R\$ -	R\$ -
TOTAL GERAL	R\$ 41.464.511,15	R\$ 24.833.759,61	R\$ 22.986.209,34

Quadro 38.



Relatório de Investimentos – Dezembro/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				
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 30.459.468,00	9,29%	5,00%	70,00%	art. 7º, inciso III, "a"
BRANCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 371.943.807,36				
ITAÚ 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				
ICATU 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				
ITAÚ 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				

Quadro 39.

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJJwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/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				
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 112.267.636,26				
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 43.715.099,18				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 185.786.482,44				
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 31.831.747,06				
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.352.468,46				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 81.311.552,03				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 93.874.541,89				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 69.154.719,11				
OCCAM FIC FIA	R\$ 119.142.731,56				
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL 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 40.

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 NIVEL I	R\$ 56.680.008,07	2,01%	5,00%		art 9º-A, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 44.048.915,69				
ITAU BDR NIVEL 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 41.



Relatório de Investimentos – Dezembro/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 42.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJJwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/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%	
	ITAÚ 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%	
	ITAÚ 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 MAC'TH 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 INSTTUCIONAL FIA	R\$ 93.214.497,15	1,36%	
	GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 78.742.664,68	1,15%	
	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 40.709.417,60	0,59%	
	TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 49.506.181,90	0,72%	
	TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 68.123.567,30	0,99%	
	TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 4.750.832,68	0,07%	
	CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 40.039.781,67	0,58%	
	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	R\$ 4.182.085,85	0,06%	
	CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 14.109.109,63	0,21%	
4UM SMALL CAPS FIA	R\$ 39.787.362,84	0,58%		
INVEST NO EXTERIOR - FI	BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 47.028.246,43	0,68%	20%
	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 32.447.139,23	0,47%	
	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 12.838.980,43	0,19%	
	SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 44.790.174,49	0,65%	
	SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 25.059.710,90	0,36%	
FIA - BDR	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 56.680.008,07	0,83%	20%
	ITAÚ BDR NIVE I AÇÕES	R\$ 35.734.854,74	0,52%	
FUNDOS MULTIMERCADO	SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 44.048.915,69	0,64%	20%
	SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 31.624.240,50	0,46%	
	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 43.



Relatório de Investimentos – Dezembro/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%	
FI RF CREDITO PRIVADO	ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 98.145,85	R\$ 2.189.575.950,42	0,00%	5%
	ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 2.259.367,15	R\$ 1.369.079.222,31	0,17%	
	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%	
FUNDOS DE AÇÕES	MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 62.490.499,08	R\$ 1.295.296.130,64	4,82%	15%
	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 66.723.073,47	R\$ 740.791.723,00	9,01%	
	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%	
	ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 81.311.552,03	R\$ 904.482.272,88	8,99%	
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 93.874.541,89	R\$ 1.879.797.625,43	4,99%	
	ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 69.154.719,11	R\$ 548.962.862,29	12,60%	
	OCCAM FIC FIA	R\$ 119.142.731,56	R\$ 991.881.622,41	12,01%	
	VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 93.214.497,15	R\$ 833.769.932,26	11,18%	
	GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 78.742.664,68	R\$ 859.169.719,10	9,16%	
	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 40.709.417,60	R\$ 535.560.916,74	7,60%	
	TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 49.506.181,90	R\$ 989.019.644,80	5,01%	
	TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 68.123.567,30	R\$ 590.953.322,47	11,53%	
	TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 4.750.832,68	R\$ 97.814.521,98	4,86%	
	CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 40.039.781,67	R\$ 1.212.571.725,68	3,30%	
	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	R\$ 4.182.085,85	R\$ 328.007.076,41	1,27%	
	CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 14.109.109,63	R\$ 548.029.386,77	2,57%	
4UM SMALL CAPS FIA	R\$ 39.787.362,84	R\$ 328.007.076,41	12,13%		
INVEST NO EXTERIOR - FI	BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 47.028.246,43	R\$ 1.216.732.605,32	3,87%	15%
	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 32.447.139,23	R\$ 107.130.105.850,39	0,03%	
	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 12.838.980,43	R\$ 12.423.047.296,08	0,10%	
	SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 44.790.174,49	R\$ 996.043.275,47	4,50%	
	SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 25.059.710,90	R\$ 17.564.513.792,89	0,14%	
FIA - BDR	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 56.680.008,07	R\$ 1.279.513.840,76	4,43%	15%
	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%	
	ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 150.198,45	R\$ 1.178.133.424,16	0,01%	
	FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$ 15.383.696,84	R\$ 110.804.751,51	13,88%	
	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ 17.081.845,43	R\$ 161.014.511,10	10,61%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM - FUNDO NOVO	R\$ 10.287.728,13	R\$ 161.319.375,60	6,38%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$ 30.085.990,02	R\$ 206.688.562,79	14,56%	
FIP	RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$ 15.325.287,61	R\$ 128.998.626,49	11,88%	15%
	BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 35.218.329,99	R\$ 2.533.391.882,66	1,39%	
	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%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO		R\$ 3.453.568.473,15			

Quadro 44.



Relatório de Investimentos – Dezembro/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%	
BRADESCO	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 45.

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



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

DISTRIBUIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR GESTOR DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS

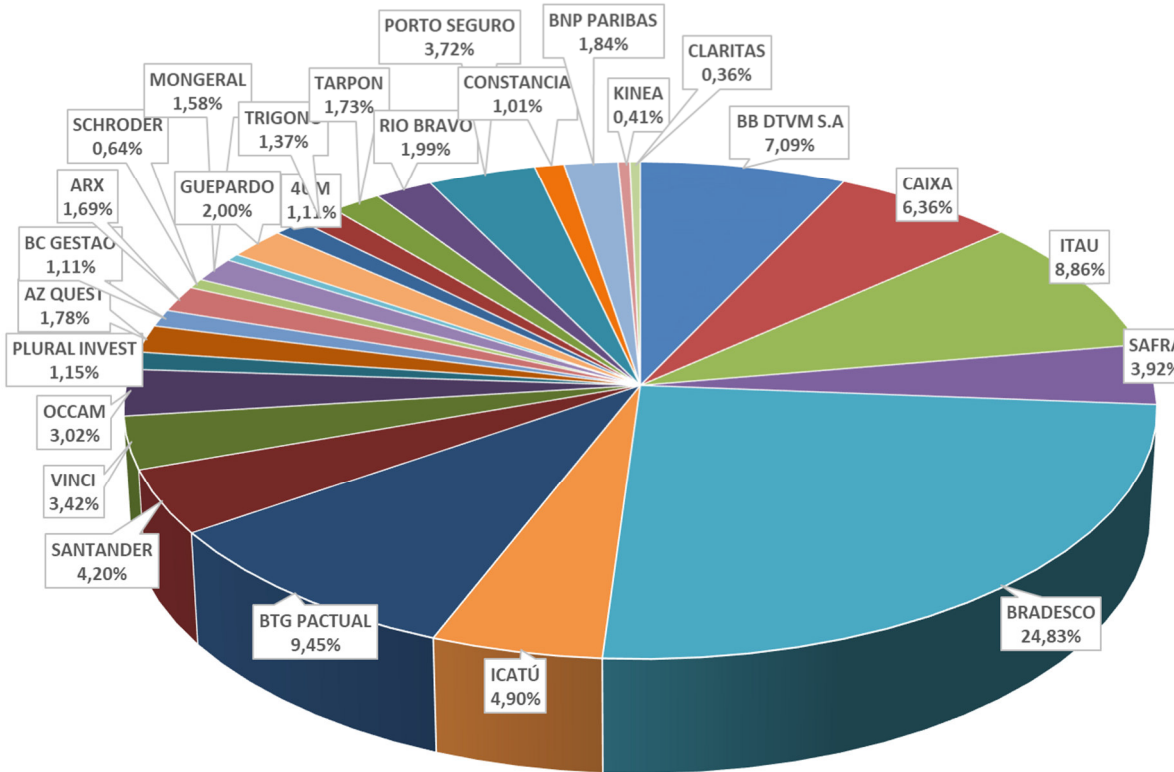


Gráfico 7.

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 3.686.243.956,25
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 3.091.635.045,97
TÍTULOS - CVS	R\$ 7.083.711,95
IMÓVEIS	R\$ 65.484.778,63
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 17.564.101,93
TOTAL	R\$ 6.868.011.594,73

Quadro 46.



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

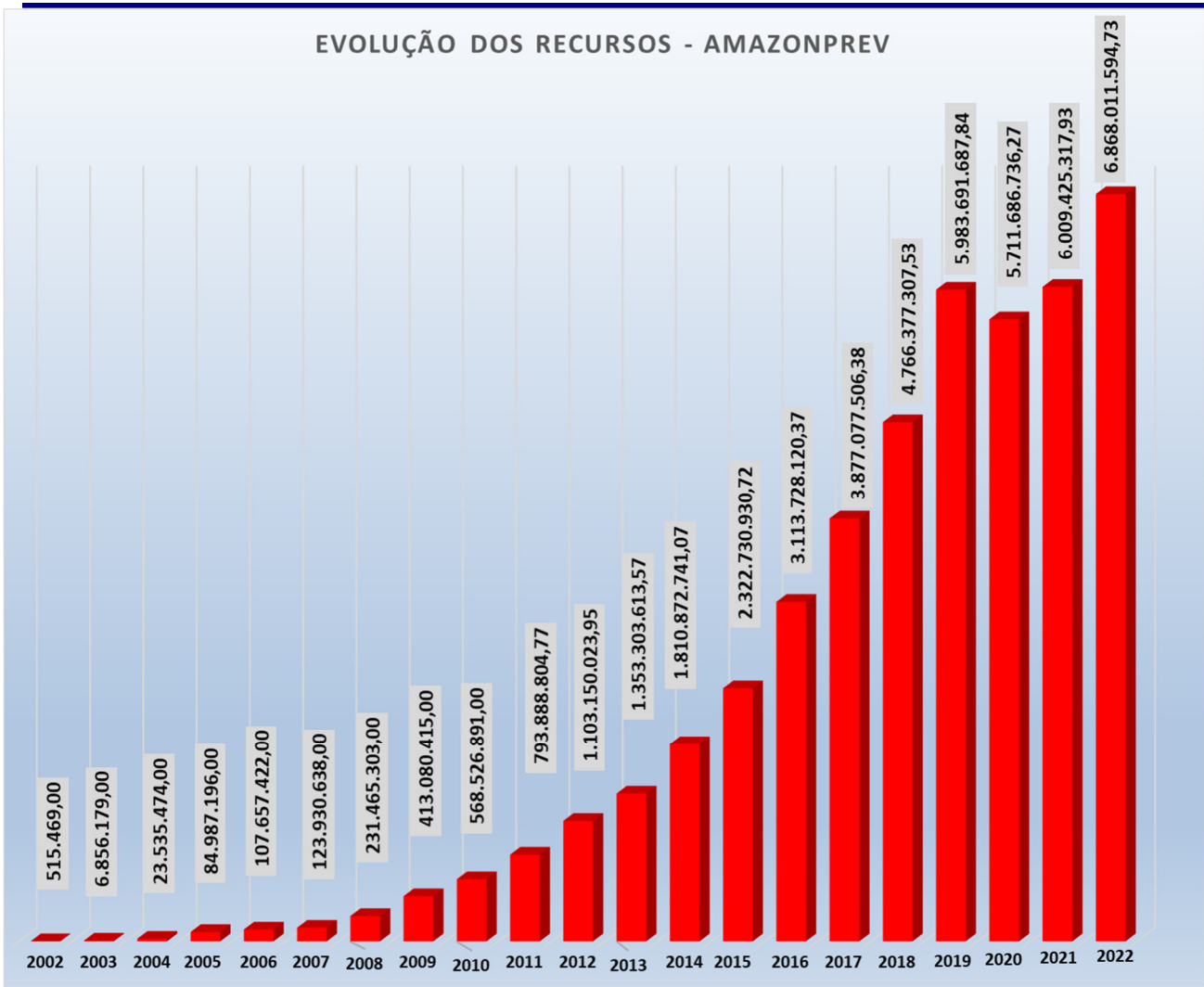


Gráfico 8.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJUwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

13. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV/EXECUTIVO	Novos Recursos Executivo: aplicar no fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2023
	Demais Recursos: 1. Migrar R\$ 40 milhões do fundo Itaú Ações Dunamis FIC (24.571.992/0001-75) para o fundo Itaú Soberano Simples FIC (06.175.696/0001-73) 2. Migrar R\$ 20 milhões do fundo OCCAM FIC FIA para o fundo Bradesco DI Premium. 3. Migrar R\$ 5 milhões do fundo Itaú BDR Nível 1 (37.306.507/0001-88) para o Itaú Soberano Simples FIC (06.175.696/0001-73)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2023
FPREV/ASSEMBLEIA	Novos Recursos ALE: aplicar no fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2023
	b) Recursos Atuais: 1. Zerar posição nos fundos alocados em RF (art. 7º III-a) nas instituições Caixa/BB/Safra/Icatu, migrando para o Bradesco DI Premium (pendente da Ata anterior). 2. Zerar posição no fundo Icatu Vanguarda Crédito Privado migrando para Bradesco DI Premium. 3. Migrar R\$ 1 milhão do fundo OCCAM FIC FIA para o fundo Bradesco DI Premium. 4. Zerar posição no fundo Safra Consumo Americano BDR Nível 1 para o fundo Safra Soberano RP DI FIC REF	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2023
FPREV/TCE, TJA, MPE, DPE	Novos Recursos TCE/ TJA/MPE/DPE: aplicar no fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2023
	b) MPE - Recursos Atuais: 1. Migrar R\$ 2 milhões do fundo Guepardo Institucional FIC FIA para o fundo Bradesco DI Premium. 2. Migrar R\$ 1 milhão do fundo Trígono Flagship Ins FIC FIA para o fundo Bradesco DI Premium. 3. Migrar R\$ 5 milhões do BB Ações Valor FIC FIA para o fundo BB Previdenciário RF Perfil.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2023
FFIN (Executivo, ALE, TCE, TJA, MPE, DPE, FPPM)	Aplicar os recursos no fundo Bradesco Maxi Poder Público ou CDB Fácil Bradesco, 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	15/02/2023
RECURSOS COMPREV	Novos recursos aplicar no fundo Bradesco Maxi Poder Público.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2023
DISPONIBILIDADES DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	Os Novos Recursos devem ser aplicados no fundo Maxi Poder Público ou CDB Fácil Bradesco.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/02/2023

Quadro 47.

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

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJUwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/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	MáxDrowdown 12M	12M	dez22	2022
						RETORNO	RETORNO	RETORNO
TÍTULOS PÚBLICOS DO TESOURO	R\$ 2.772.466.968,18	R\$ 3.101.722.106,85						
TOTAL - art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 2.772.466.968,18	R\$ 3.101.722.106,85						
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso I, "b"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	dez22	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%
Safrá Sob Reg Proprio Fc FI RF RefDI	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	MáxDrowdown 12M	12M	dez22	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 RefDI 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 RefDI 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 RefDI 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	MáxDrowdown 12M	12M	dez22	2022
						RETORNO	RETORNO	RETORNO
Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	R\$ 2.236.339,00	R\$ 2.259.367,15	3,40%	0,35%	-1,68	10,95%	1,03%	10,95%
Mag Cred Priv FI RF LP	R\$ 61.737.702,93	R\$ 62.490.499,08	0,12%	0,01%	0,00	13,61%	1,22%	13,61%
Sant RF Cred Priv Crescimento Inst FI LP	R\$ 119.500.510,90	R\$ 120.910.991,78	0,14%	0,01%	-0,02	13,52%	1,18%	13,52%
BTG Pact Cre Cor I Fc FI RF Cred Priv LP	R\$ 98.649.141,11	R\$ 99.828.572,85	0,17%	0,02%	0,00	14,24%	1,20%	14,24%
Porto Seguro FI RF Refer DI Cred Priv	R\$ 145.463.980,25	R\$ 147.168.816,77	0,09%	0,01%	0,00	13,21%	1,17%	13,21%
Bupp Match DI FI RF RefCred 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: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MJUwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/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%
Oceam 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: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJJwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

						12M	dez/22	2022
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Mult Global Select Equity Ie FI	R\$ 47.431.727,99	R\$ 47.028.246,43	25,48%	2,64%	0,00	-19,25%	-0,85%	-19,25%
Sant Global Equi Dolar Mas Mult Ie Fc FI	R\$ 45.771.735,48	R\$ 44.790.174,49	22,02%	2,28%	0,00	-25,55%	-2,14%	-25,55%
Schroder Sustentabilidade Ações Globais Usd FICFIA	R\$ 25.010.046,68	R\$ 25.059.710,90	25,86%	2,68%	0,00	-22,26%	0,20%	-22,26%
Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	R\$ 13.796.522,63	R\$ 12.838.980,43	58,54%	6,08%	0,00	-62,70%	-6,94%	-62,70%
Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	R\$ 32.241.790,80	R\$ 32.447.139,23	26,05%	2,70%	0,00	-21,61%	0,64%	-21,61%
TOTAL - art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 164.251.823,58	R\$ 162.164.251,48						
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR TOTAL art 9º - A - III - BDR Nivel I	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
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 I Acoes Fc	R\$ 37.117.636,77	R\$ 35.734.854,74	23,07%	2,40%	0,00	-15,03%	-3,73%	-15,03%
Safra 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 Nivel 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	MáxDrawdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
Safra 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 Brl 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 Brl 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	MáxDrawdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
BTG Pactual Economia Real FI Partie 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 CIA	R\$ 998.994,63	R\$ 1.112.237,95			-19,47		-1,40%	
BTG Pa Inv de Im FI Participac Mult CIA	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 de Investimentos – Dezembro/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.

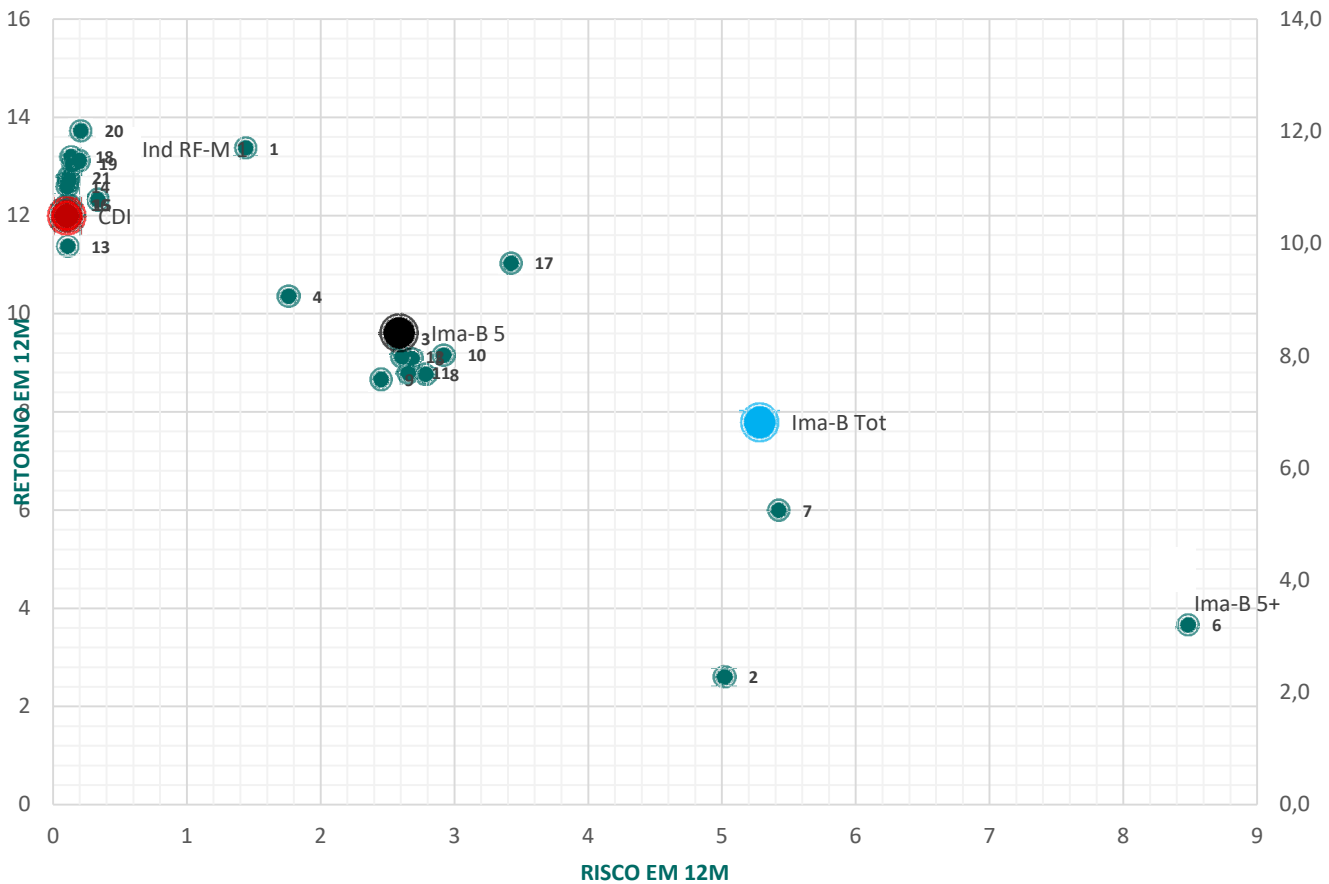


Gráfico 1: Art. 7º Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42
 Documento assinado eletronicamente 250055/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MJJwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/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.

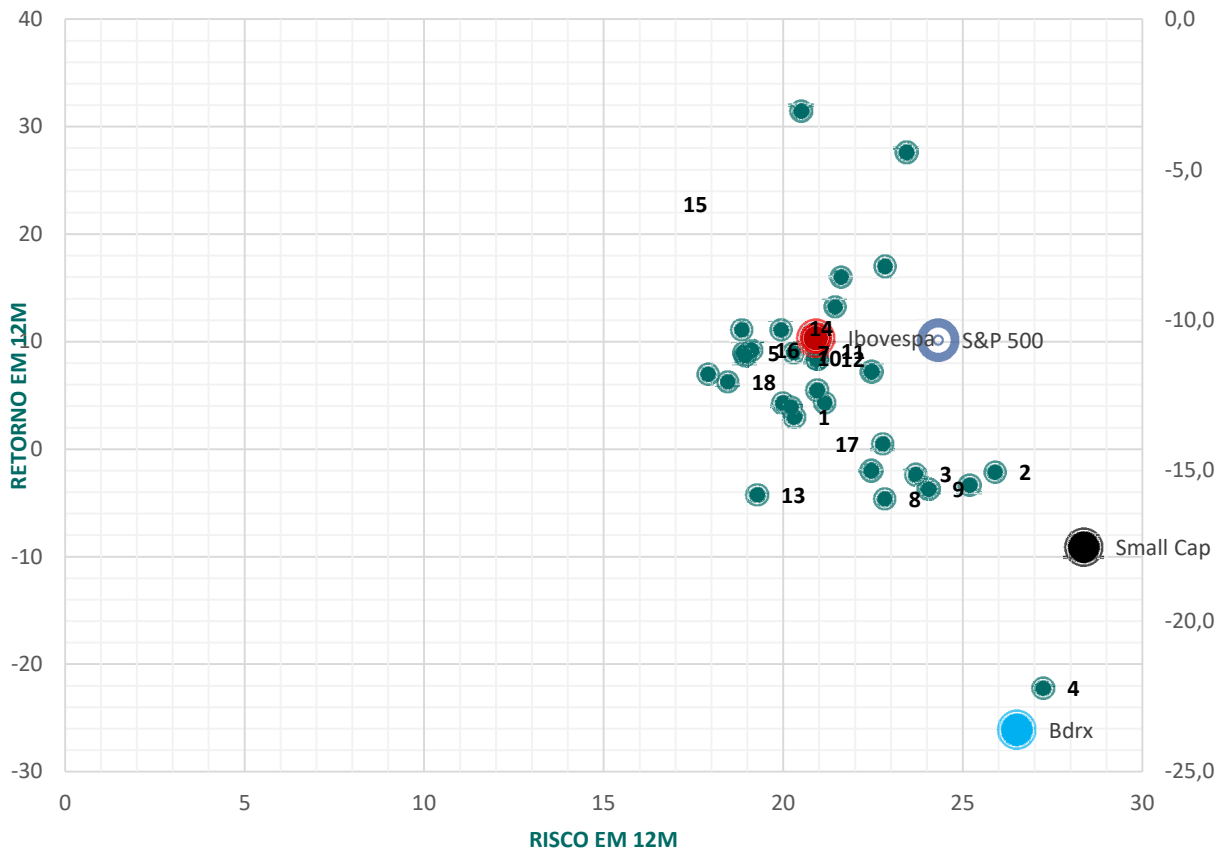


Gráfico 2: Art. 8º Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJUwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

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.

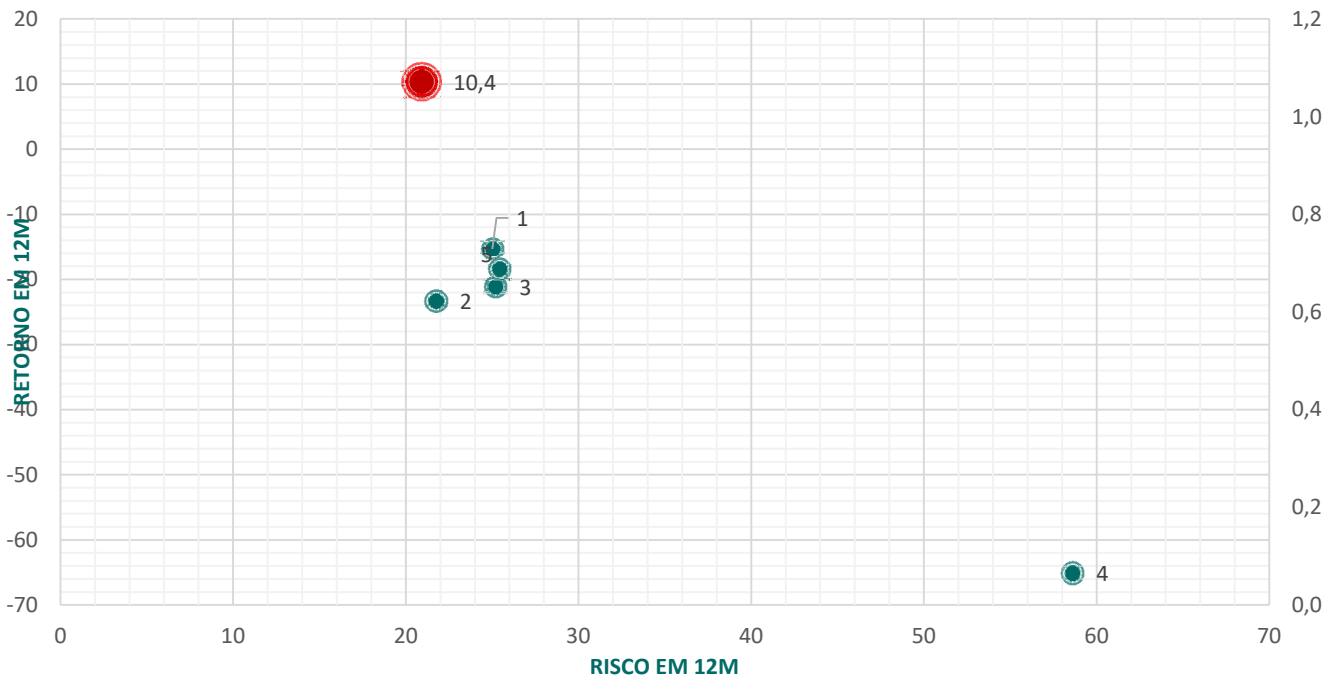


Gráfico 3: Art. 9-A-IIº Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MJUwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/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.

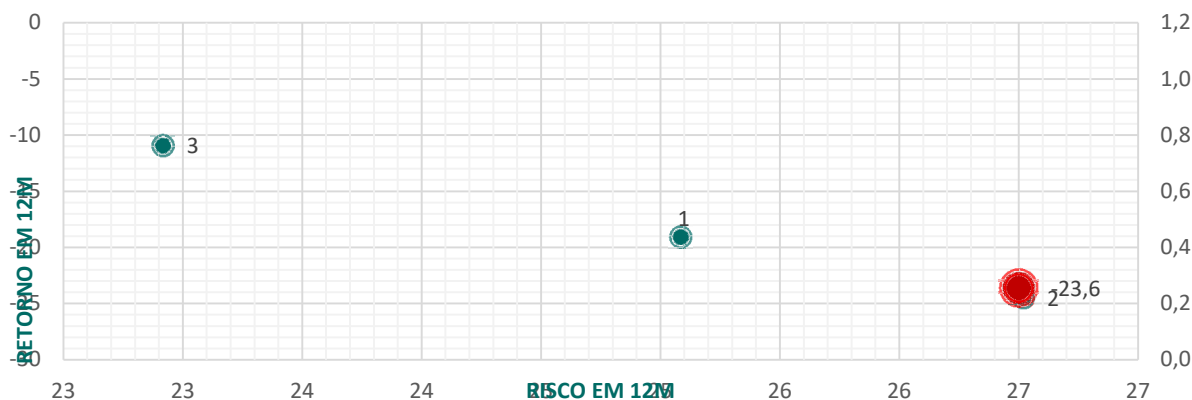


Gráfico 4: Art. 9-A-IIIº Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)

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.

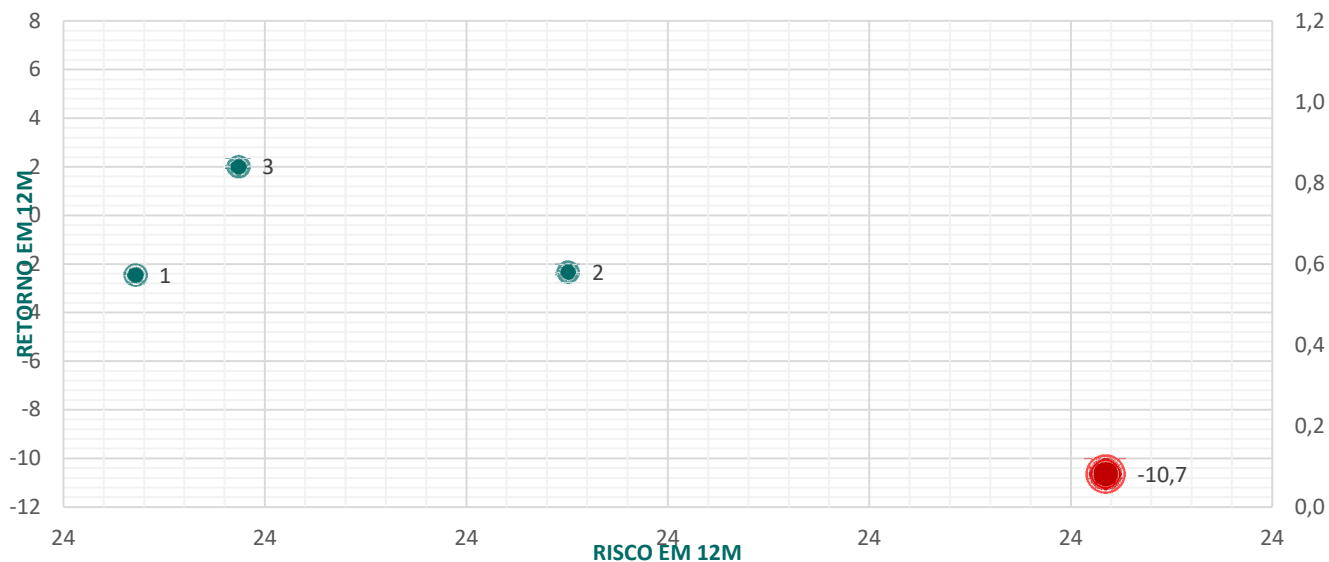


Gráfico 5: Art. 10º Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJUwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/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: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 16/01/2023 10:57:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 16/01/2023 10:56:24

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 13/01/2023 13:48:40
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 13/01/2023 13:51:12
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 13/01/2023 13:52:16
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 13/01/2023 13:57:29
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 16/01/2023 09:25:42

Documento assinado eletronicamente 250055/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJUwMDU1



Relatório de Investimentos – Dezembro/2022

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 13 de janeiro de 2023, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de Dezembro/2022, com o acompanhamento da Rentabilidade e Risco das diversas modalidades de operações realizadas nas aplicações dos recursos do RPPS.

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

Todas as operações efetuadas foram devidamente autorizadas pela Diretoria, com registro nas Atas de Reunião do Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev.

Manaus – AM, 13 de janeiro de 2023.

Alan Nascimento
Coordenador

Bruno Costa Novo
Secretário

Bruno Barroso
Membro

Leonardo Cavalcanti
Membro

Wellington Guimaraes
Membro

Claudinei Soares
Membro

André Luiz Bentes
Membro

Marcos Souza
Membro



Gestão de Investimentos

Credenciamento de Instituições Financeiras

- [Edital de Credenciamento de Instituições Financeiras 2022](#)
- [LISTA DE INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS CREDENCIADAS 2023](#)
- Link para credenciamento: www.portaldosegurado.am.gov.br:85/credenciamento

Legislação




- [Resolução BACEN](#)
- [Resolução BACEN](#)
- [Portaria MPT 1467-2022](#)
- [Portaria SPREV nº 4/2018](#)
- [Portaria MPS nº 519/2011](#)
- [Resolução CMN nº 4.963 / 2021](#)
- [PORTARIA SPREV Nº 14.770](#)

Composição do Comitê

[Portaria N 953/2021 Nomeação COMIV Biênio 2022-2023](#)

[Portaria 0007/2020 - Biênio 2020-2021](#)

[Portaria 631-2019-COMIV](#)

-  Institucional
-  Conselhos
-  Controle Interno
-  Execução Orçamentária
-  Documentos Legais
-  Licitações e Contratos
-  Convênios
-  Gestão de Investimentos
-  Encerramento do Exercício
-  Cálculo Atuarial
-  Programas

<https://www.amazonprev.am.gov.br/acesso-a-informacao/>