

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

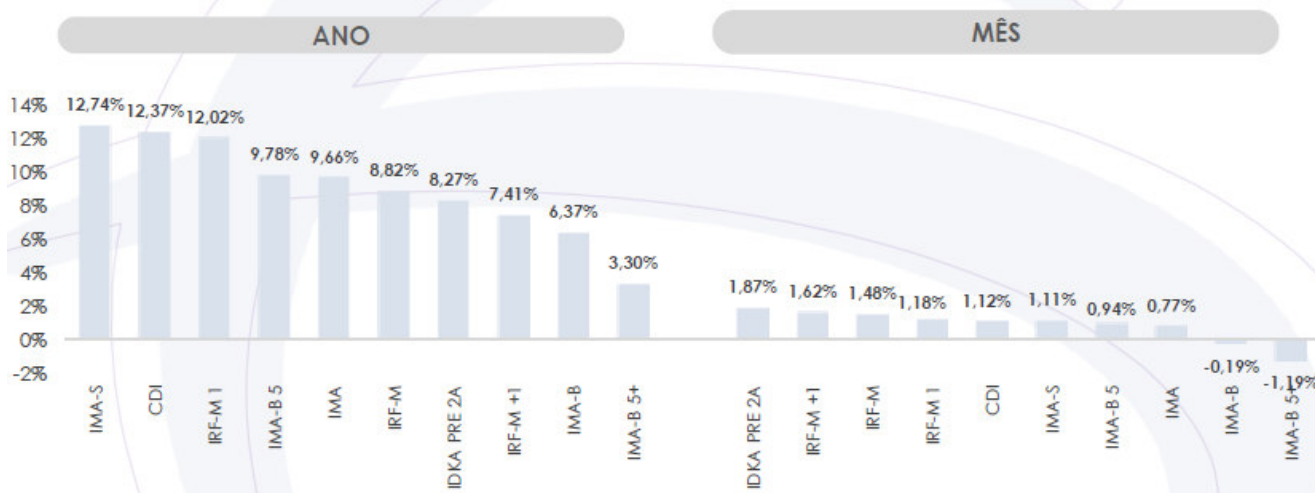
O ciclo inflacionário parece ter alcançado seu pico. O aperto monetário se encaminha para o estágio final e, por consequência, crescem as discussões sobre um possível corte de juros para frente. No mundo, existem evidências de queda da inflação em bens industrializados devido ao rebalanceamento da demanda 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
 Acesso: <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

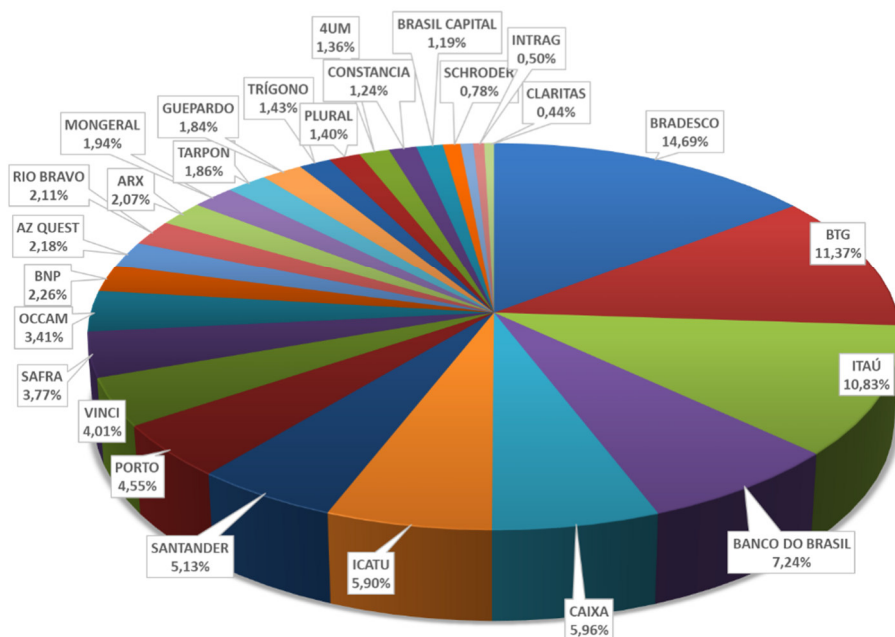


Gráfico 1.



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: MJUwMDU1



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

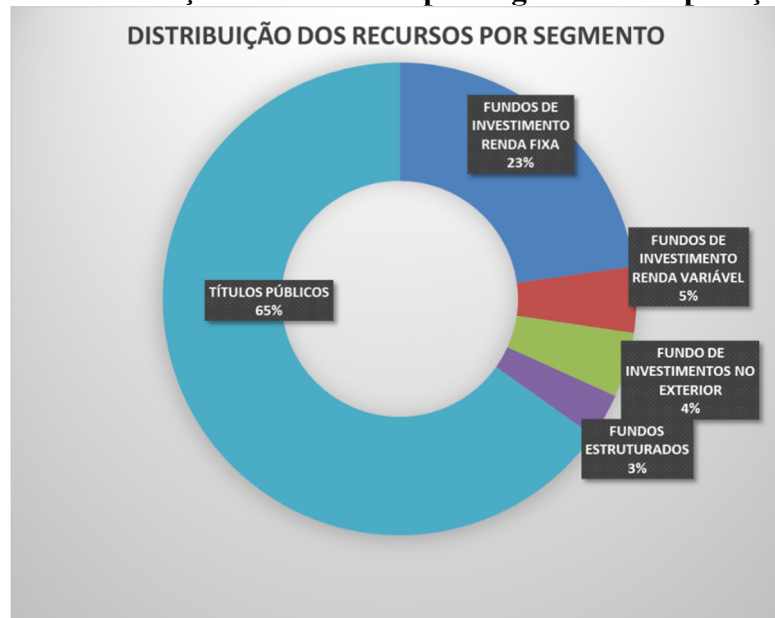


Gráfico 3.

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 AMÁZONAS
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: MJUwMDU1



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
 Acesso: <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

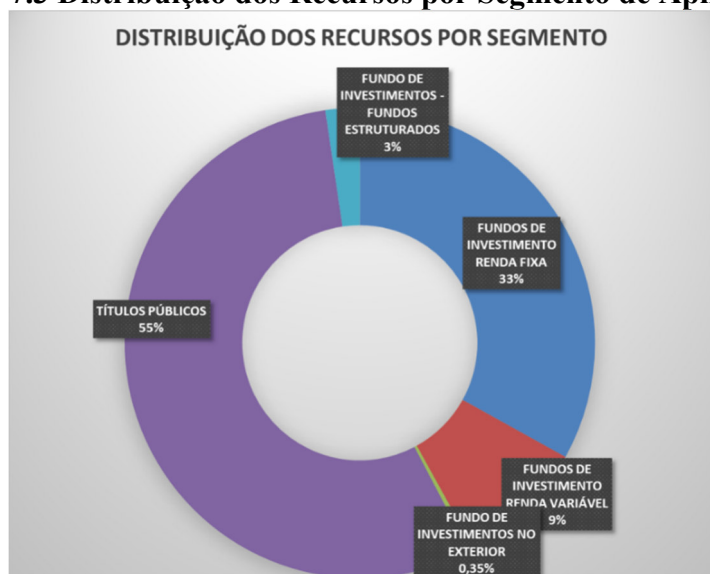


Gráfico 4.

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: MJUwMDU1



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

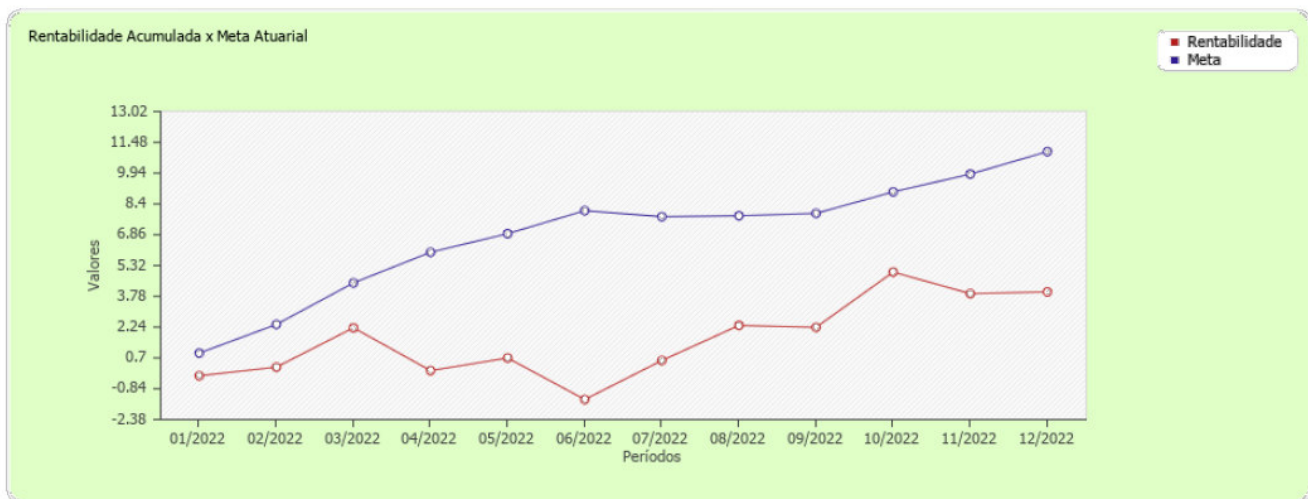


Gráfico 6.

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
Acesse: <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 TESOUREIRO 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				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 55.189.263,72	2,10%	9,00%	100,00%	art. 7º, Inciso I, "b"
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				
BRANCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 371.943.807,36	9,29%	5,00%	70,00%	art. 7º, inciso III, "a"
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
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MJUwMDU1



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%	
	INVEST NO EXTERIOR - FI	TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 4.750.832,68	R\$ 97.814.521,98	
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%	
4UM SMALL CAPS FIA		R\$ 39.787.362,84	R\$ 328.007.076,41	12,13%	
BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR		R\$ 47.028.246,43	R\$ 1.216.732.605,32	3,87%	
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%	
FIA - BDR	SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 25.059.710,90	R\$ 17.564.513.792,89	0,14%	15%
	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 56.680.008,07	R\$ 1.279.513.840,76	4,43%	
	ITAU BDR NIVEL I AÇÕES	R\$ 35.734.854,74	R\$ 208.983.799,03	17,10%	
FUNDOS MULTIMERCADO	SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 44.048.915,69	R\$ 910.995.998,19	4,84%	15%
	SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 31.624.240,50	R\$ 643.989.310,17	4,91%	
	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%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO	CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$ 1.112.237,95	R\$ 10.269.855,49	10,83%	15%
	BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 19.233.118,99	R\$ 395.520.763,16	4,86%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO		R\$ 3.453.568.473,15			

Quadro 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

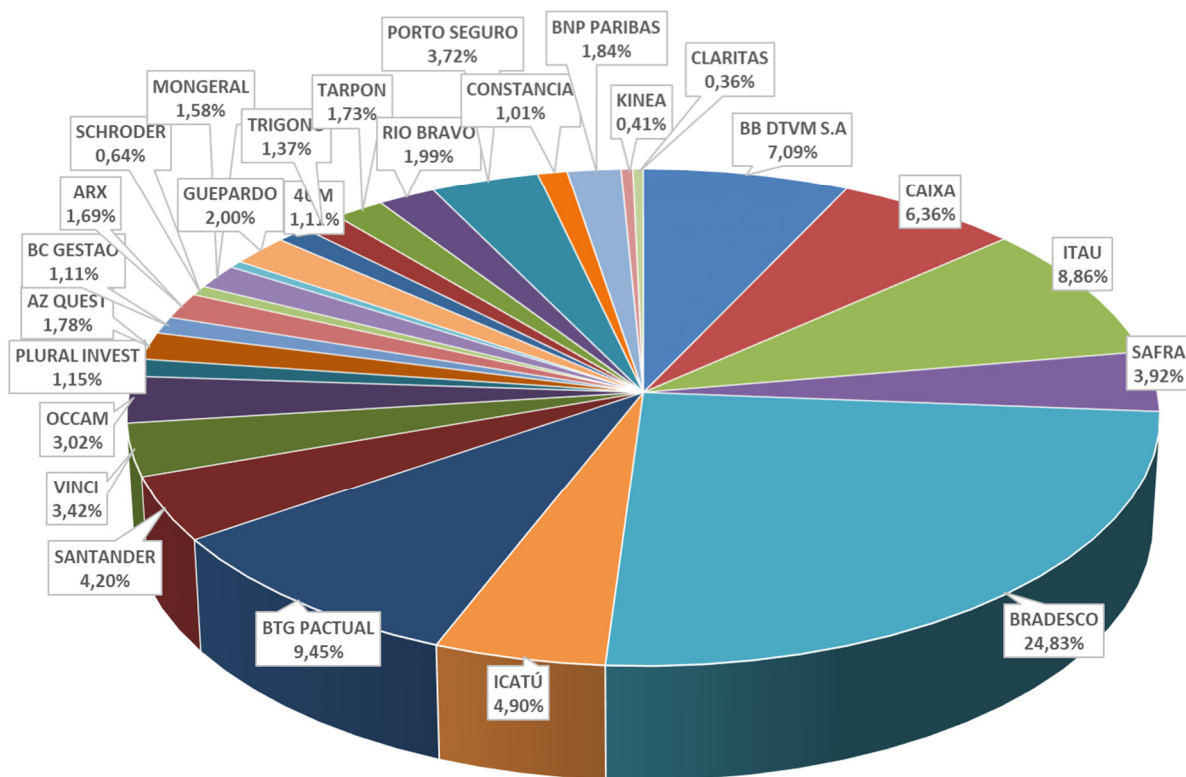


Gráfico 7.

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

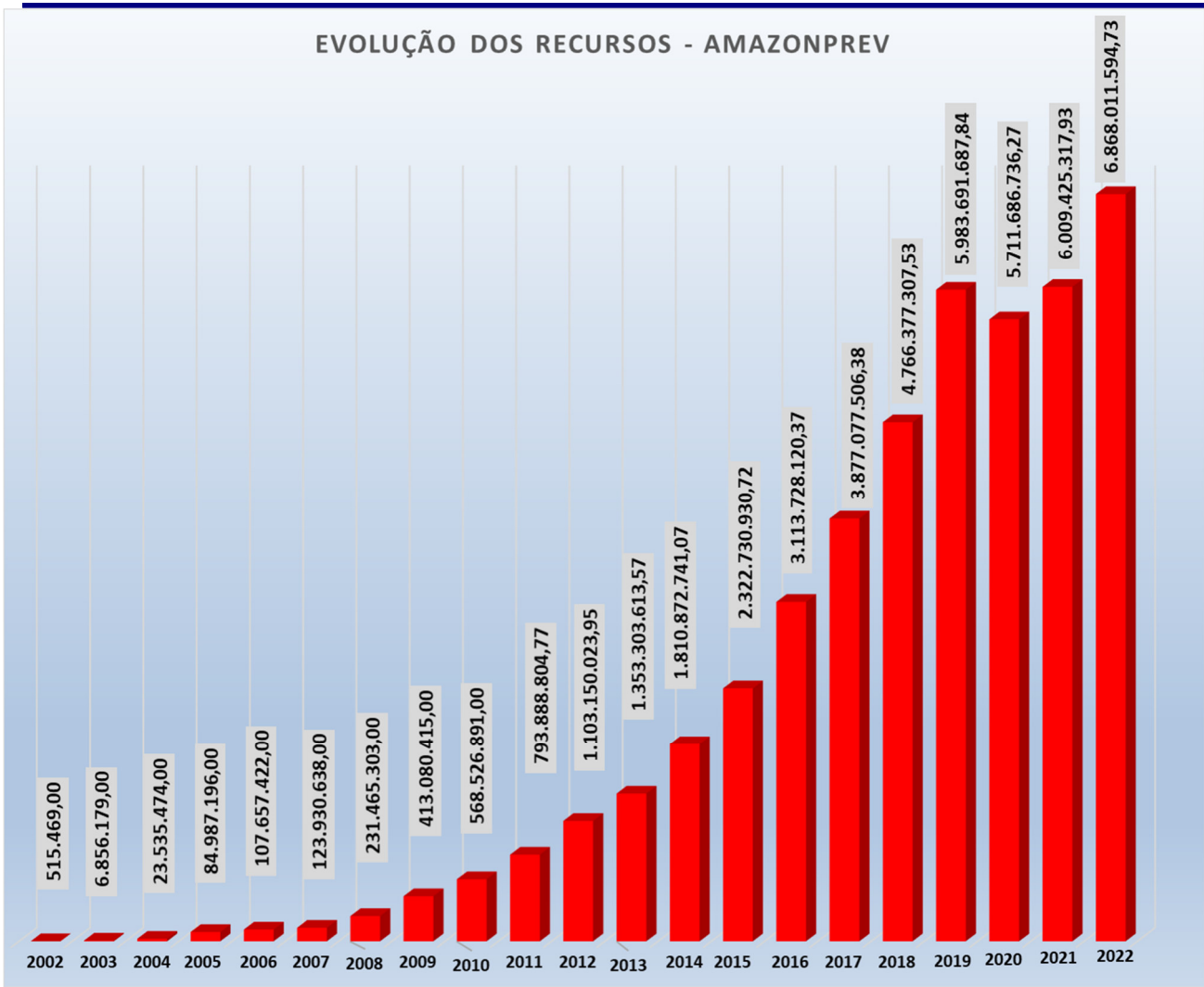


Gráfico 8.

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



RELATÓRIOS - 2022

RELATÓRIO DE RISCOS FPREV - AMAZONPREV

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

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 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



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	MáxDropdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Mult Global Select Equity Ie FI	RS 47.431.727,99	RS 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	RS 45.771.735,48	RS 44.790.174,49	22,02%	2,28%	0,00	-25,55%	-2,14%	-25,55%
Schroder Sustentabilidade Ações Globais Usd FICFIA	RS 25.010.046,68	RS 25.059.710,90	25,86%	2,68%	0,00	-22,26%	0,20%	-22,26%
Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	RS 13.796.522,63	RS 12.838.980,43	58,54%	6,08%	0,00	-62,70%	-6,94%	-62,70%
Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	RS 32.241.790,80	RS 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	RS 164.251.823,58	RS 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	MáxDropdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Acoes Esg Is FIA -Bdr Nivel I	RS 59.530.145,18	RS 56.680.008,07	25,27%	2,62%	0,00	-25,15%	-4,79%	-25,15%
Itau Bdr Nivel I Acoes Fc	RS 37.117.636,77	RS 35.734.854,74	23,07%	2,40%	0,00	-15,03%	-3,73%	-15,03%
Safra Consumo Americano FIA Bdr Nivel I	RS 46.206.100,77	RS 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	RS 142.853.882,72	RS 136.463.778,50						
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS TOTAL art 10º, I, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDropdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
Safra S&P Reais Pb Fc FI Mult	RS 33.222.136,02	RS 31.624.240,40	23,87%	2,46%	-0,14	-11,92%	-4,81%	-11,92%
BTG Pactual S&P 500 Brl FI Mult	RS 34.482.248,57	RS 32.804.508,60	23,91%	2,47%	-0,14	-7,99%	-4,87%	-7,99%
Itau Private Mult S&P500 Brl Fc	RS 157.793,15	RS 150.198,45	24,07%	2,48%	-0,14	-11,92%	-4,81%	-11,92%
Cx Fc Cap Prot Bolsa de Valores IV Mult	RS 15.540.161,04	RS 15.383.696,84	10,46%	1,13%	-1,54		-1,01%	
Cx Fc Cap Prot Bols de Valores V Mult LP	RS 16.648.298,98	RS 17.081.845,43			-5,71		2,60%	
Rio Bravo Protecao II FI Mult	RS 10.343.379,54	RS 10.287.728,13			0,00		-0,54%	
Rio Bravo Protecao FI Mult	RS 15.342.706,86	RS 15.325.287,61	6,58%	0,68%	-5,79		-0,11%	
TOTAL - art. 10º, inciso I, "a"	RS 125.736.724,16	RS 122.657.505,46						
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS TOTAL art 10º, I, "b"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDropdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
BTG Pactual Economia Real FI Partic Mult	RS 35.256.952,00	RS 35.218.329,99			-1,46	57,81%	-0,11%	57,81%
Kinea P e V Feede Inst I FIP Mult	RS 16.223.398,60	RS 15.993.362,43			-12,35		-1,42%	
Vinci Strategic Partners I FIP Mult CIA	RS 998.994,63	RS 1.112.237,95			-19,47		-1,40%	
BTG Pa Inv de Im FI Participac Mult CIA	RS 12.361.498,37	RS 19.233.118,99			-1,68	5,80%	-0,85%	5,80%
TOTAL - art. 10º, inciso I, "b"	RS 64.840.843,60	RS 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.

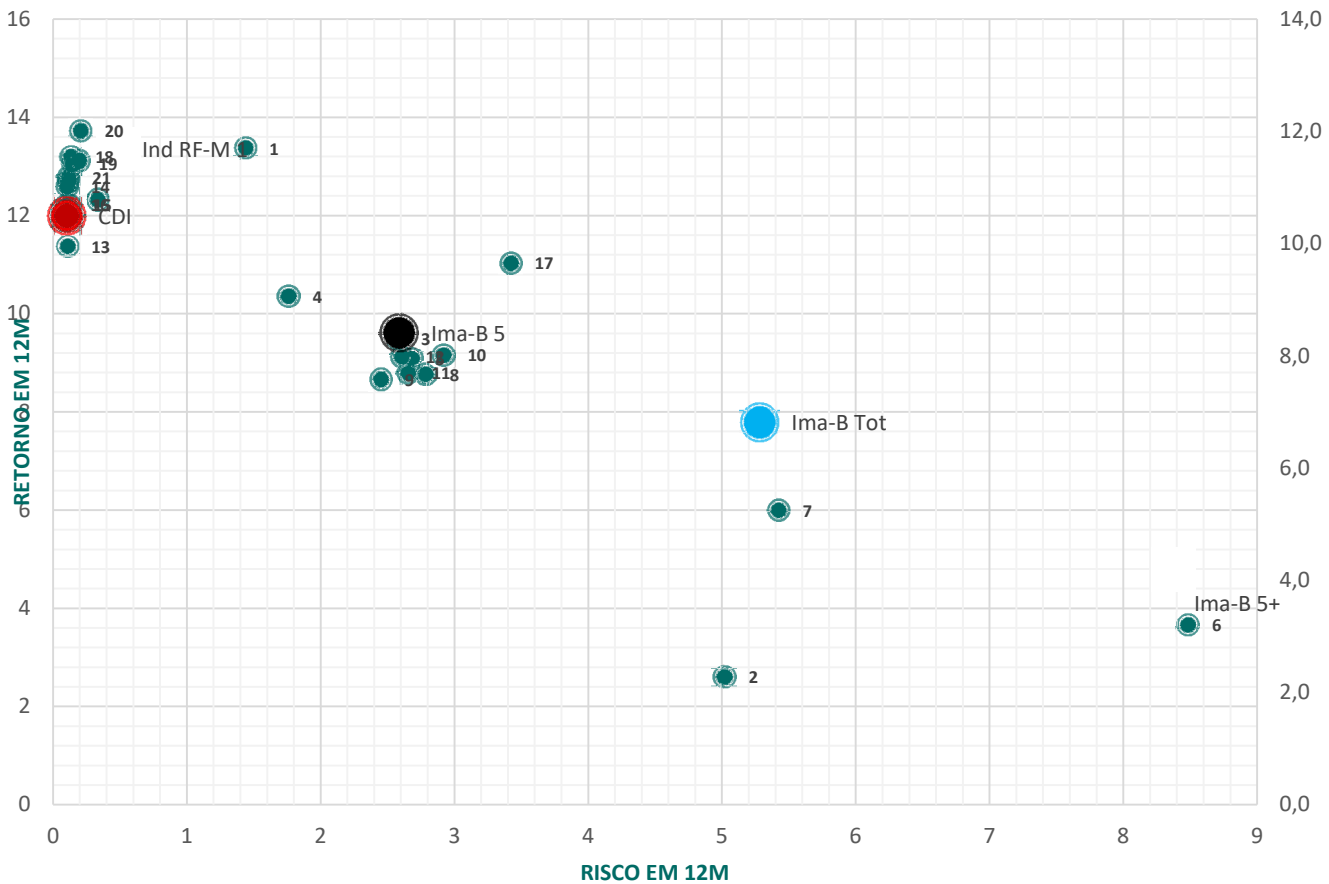


Gráfico 1: Art. 7º Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)

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.

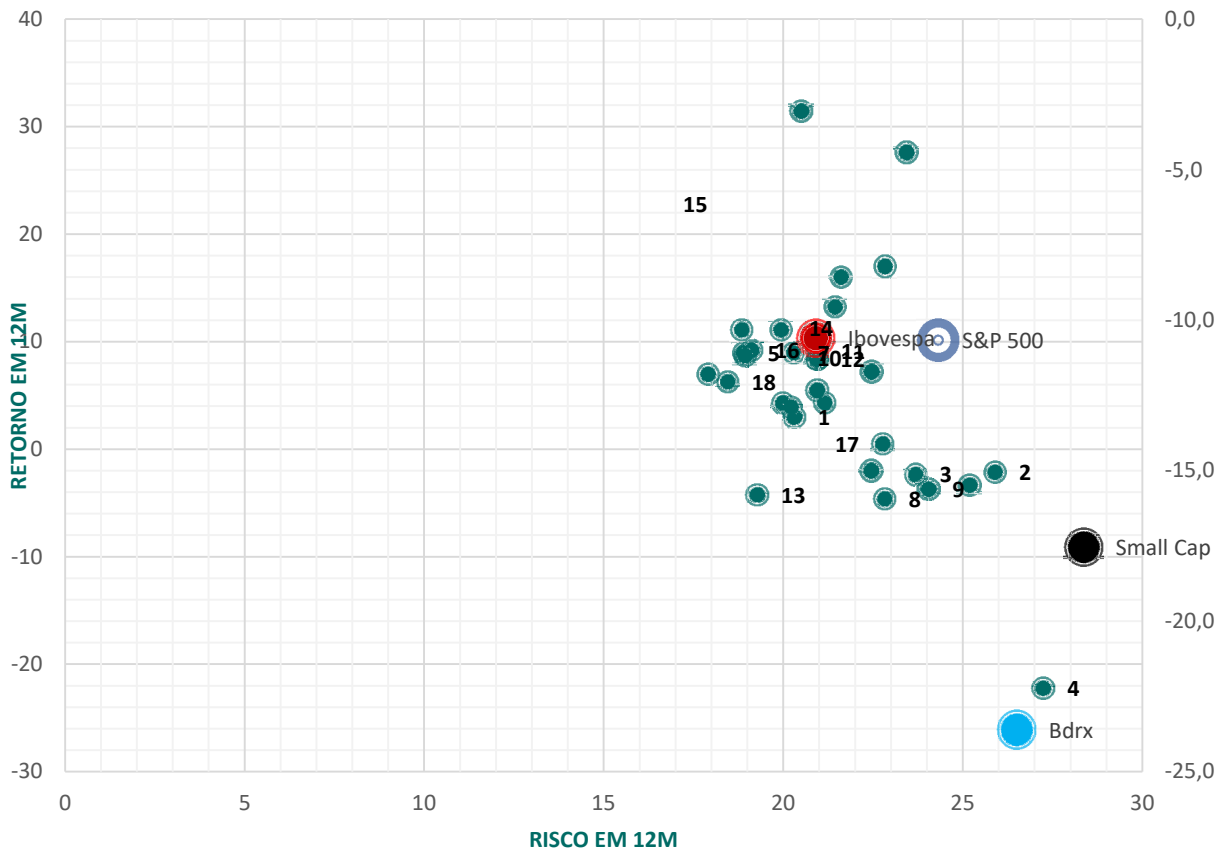


Gráfico 2: Art. 8º Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)

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 Seleoao 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 Seleoao 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 Seleoao 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.

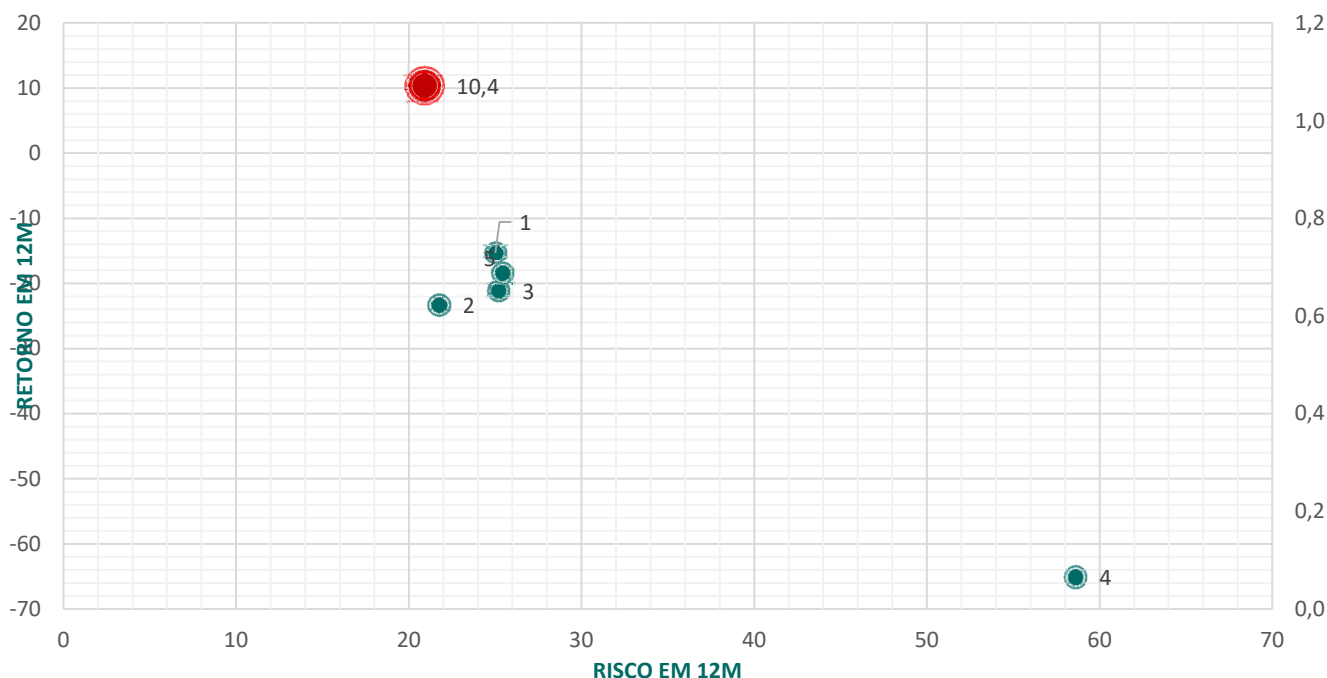


Gráfico 3: Art. 9-A-IIº Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)



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.

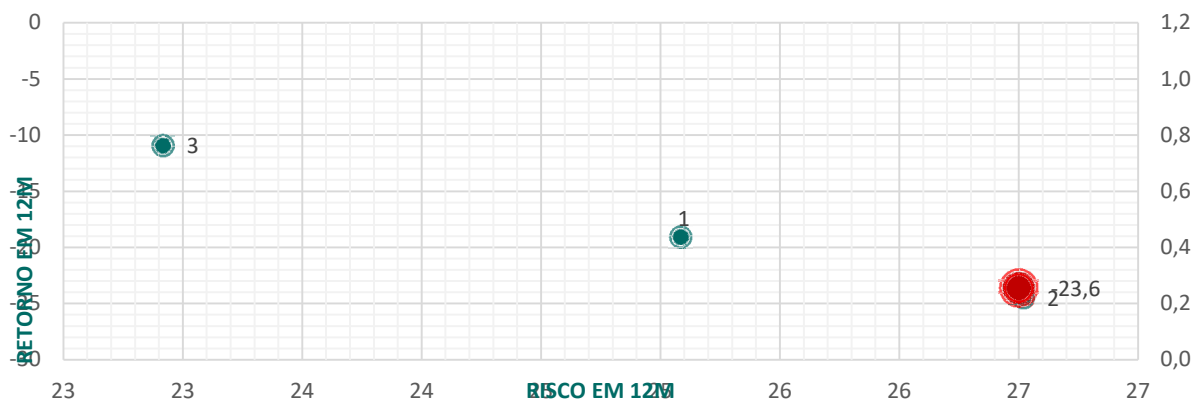


Gráfico 4: Art. 9-A-IIIº Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)

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.

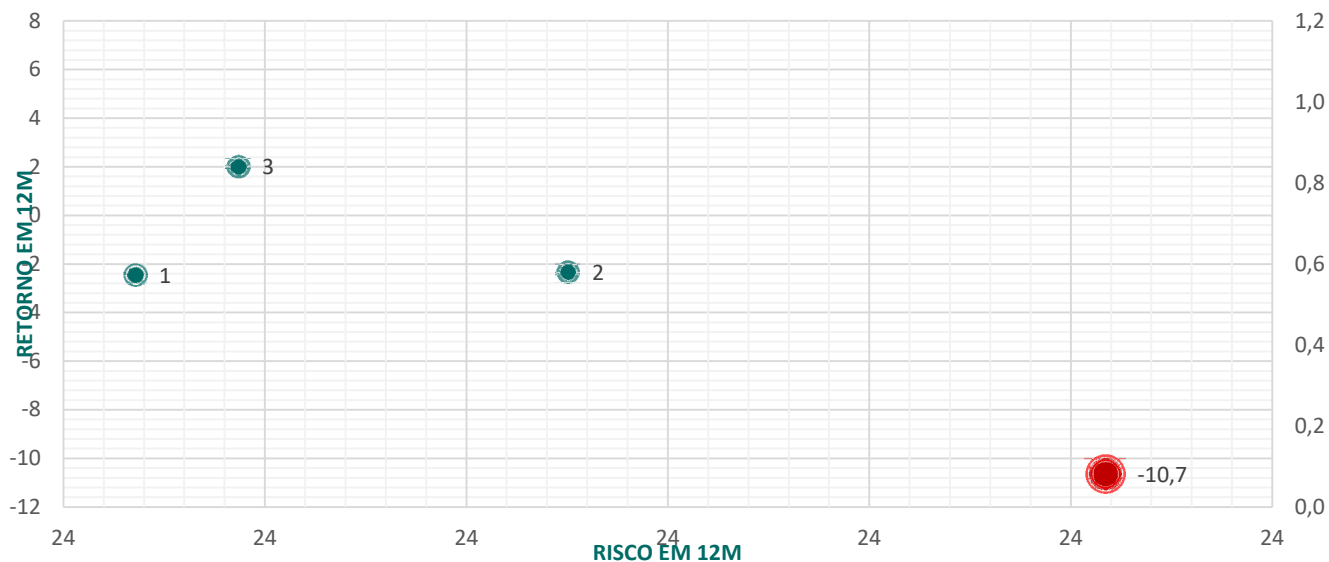


Gráfico 5: Art. 10º Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)

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

