

ANÁLISE TÉCNICA Nº 067/2022 - COFISPREV/AMPREV

Processo (s) nº (s) 2022.277.701243PA-AMPREV
Objeto Relatório de Investimentos - dezembro 2021
Relator Eduardo Corrêa Tavares

RELATÓRIO

Trata-se de análise da DEMONSTRATIVO DE CONSOLIDAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS e respectiva ata do CIAP (31/jan/22), por meio de despacho do Presidente do COFISPREV (04/ago/22), para análise por este Conselho Fiscal.

Para instrução, a Divisão de Investimentos e Mercado – DIM encaminhou processo com informações sobre os investimentos na posição de dezembro de 2021, sob orientação das diretrizes e princípios contidos na Política Anual de Investimentos, aprovada pelo Conselho Estadual de Previdência–CEP, e legislação específica em vigor, definidas pela Resolução Nº 4.963/2021-CMN e Portaria MPS nº 519/2011.

A carteira da AMPREV cumpre a legislação e a política de investimentos vigentes, confirmando-se a observância a Resolução 4.963/2021-CMN, com vinculação à Nota Técnica SEI Nº 12/2017-CGACI/SRPPS/SPREV/MF, com alocação diversificada e distribuída nas seguintes instituições:

SEGMENTO DE INVESTIMENTO	DISPONIBILIDADE TOTAL - PF + PP		
	Saldo (R\$)	Part. (%)	Rendim. Liq.-R\$
CARTEIRAS ADMINISTRADAS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	1.925.261.732,12	34,24%	7.148.600,43
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.867.485.807,50	33,22%	9.716.611,16
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	1.079.992.679,27	19,21%	30.392.037,70
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	127.797.919,77	2,27%	6.680.019,19
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	621.200.833,86	11,05%	14.686.149,40
SUBTOTAL - SOMENTE RECURSOS APLICADOS	5.621.738.972,52		68.623.417,88
SALDO EM CONTAS CORRENTES + VALORES EM TRÂNSITO	489.657,74	0,01%	
TOTAIS	5.622.228.630,26	100,00%	68.623.417,88

Os demonstrativos evidenciam ainda a estratégia de alocação para os planos previdenciário e financeiro nos demonstrativos apresentados:

ESTRATÉGIA DOS PRODUTOS DE INVESTIMENTOS DO PLANO FINANCEIRO

RENDA FIXA	VALOR - R\$	PARTIC. - %
TPF/OPERAÇÃO COMPROMISSADA EM TPF	1.304.424.878,26	32,57%
IMA-B	637.671.990,68	15,92%
IMA-B 5+	14.818.349,57	0,37%
IRF-M 1+	69.273.174,29	1,73%
IMA-GERAL	71.144.091,36	1,78%
CDI	488.602.412,10	12,20%
ALOCAÇÃO	48.623.969,61	1,21%
CRÉDITO PRIVADO	18.647.510,16	0,47%
TOTAL RENDA FIXA	2.653.206.376,03	66,26%

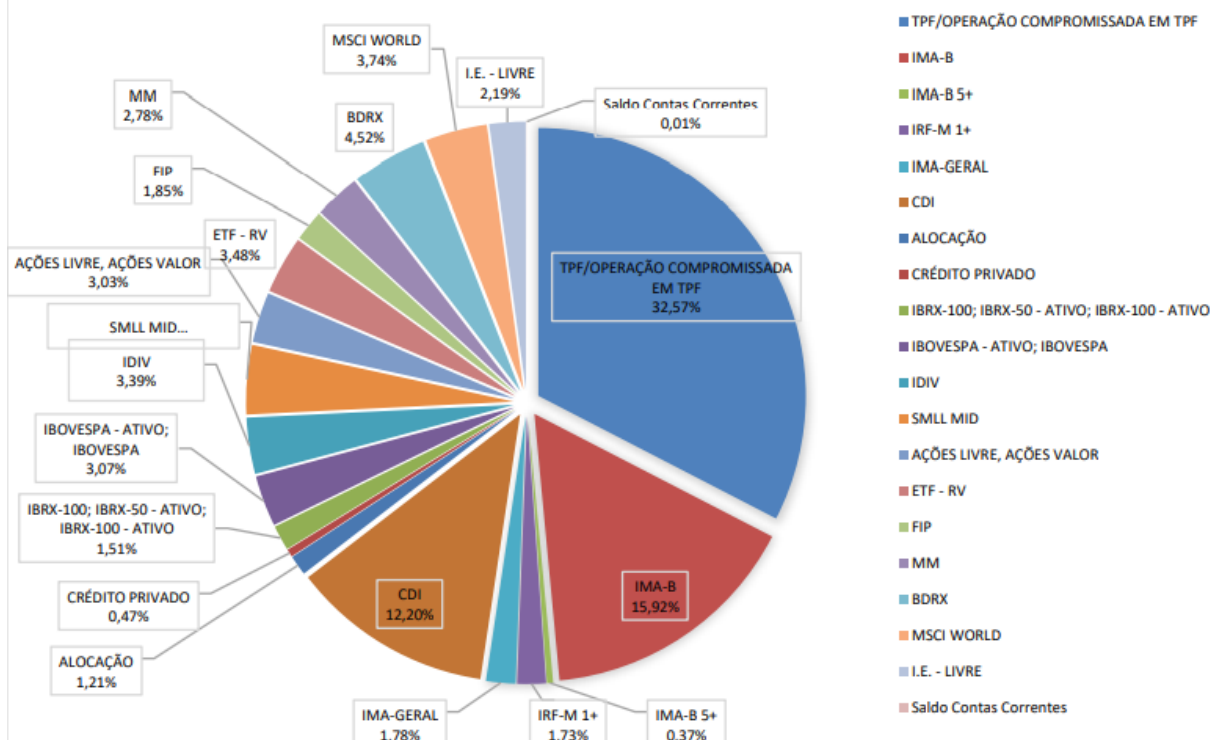
RENDA VARIÁVEL	VALOR - R\$	PARTIC. - %
IBRX-100; IBRX-50 - ATIVO; IBRX-100 - ATIVO	60.664.777,96	1,51%
IBOVESPA - ATIVO; IBOVESPA	123.079.935,93	3,07%
IDIV	135.806.422,71	3,39%
SMLL MID	166.975.528,07	4,17%
AÇÕES LIVRE, AÇÕES VALOR	121.324.117,86	3,03%
ETF - RV	139.464.786,46	3,48%
FIP	74.149.455,54	1,85%
MM	111.180.749,05	2,78%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	932.645.773,58	23,29%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	VALOR - R\$	PARTIC. - %
BDRX	181.085.106,82	4,52%
MSCI WORLD	149.584.499,71	3,74%
I.E. - LIVRE	87.514.630,97	2,19%
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	418.184.237,50	10,44%

DISPONIBILID. CONTA CORRENTE	VALOR - R\$	PARTIC. - %
Saldo Contas Correntes	487.990,10	0,01%

TOTAL GERAL	VALOR - R\$	PARTIC. - %
	4.004.524.377,21	100,00%

GRÁFICO ESTRATÉGIA DOS PRODUTOS DE INVESTIMENTOS DO PLANO FINANCEIRO



ESTRATÉGIA DOS PRODUTOS DE INVESTIMENTOS DO PLANO PREVIDENCIÁRIO

RENDA FIXA	VALOR - R\$	PARTIC. - %
TPF/OPERAÇÃO COMPROMISSADA EM TPF	620.836.853,86	38,38%
IMA-B	230.595.014,71	14,25%
IMA-B 5+	22.298.113,77	1,38%
IRF-M 1+	26.946.500,53	1,67%
IMA-GERAL	9.535.741,60	0,59%
CDI	208.417.084,14	12,88%
ALOCAÇÃO	9.161.268,32	0,57%
CRÉDITO PRIVADO	11.253.424,72	0,70%
DEBÊNT. INFRAEST.	497.161,94	0,03%
TOTAL RENDA FIXA	1.139.541.163,59	70,44%

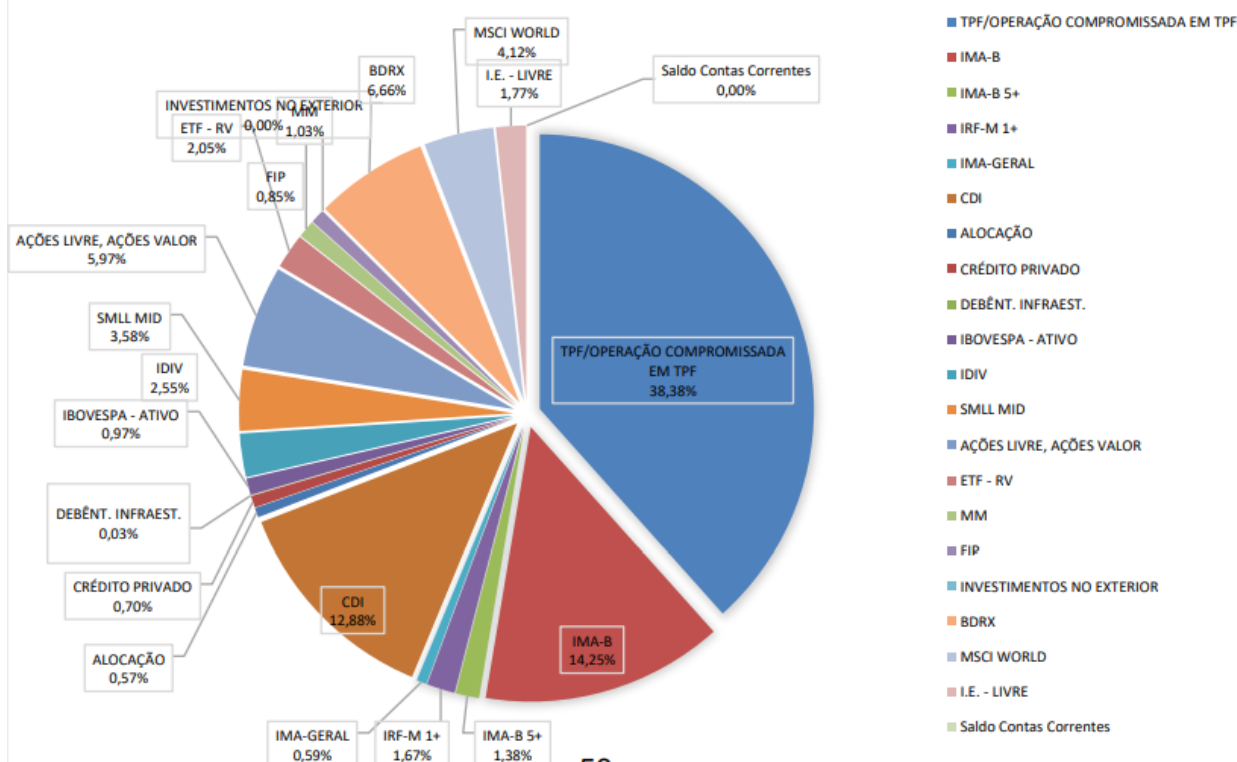
RENDA VARIÁVEL	VALOR - R\$	PARTIC. - %
IBOVESPA - ATIVO	15.724.062,40	0,97%
IDIV	41.294.430,67	2,55%
SMLL MID	57.915.494,79	3,58%
AÇÕES LIVRE, AÇÕES VALOR	96.565.331,24	5,97%
ETF - RV	33.200.227,48	2,05%
MM	16.617.170,72	1,03%
FIP	13.828.108,16	0,85%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	275.144.825,46	17,01%

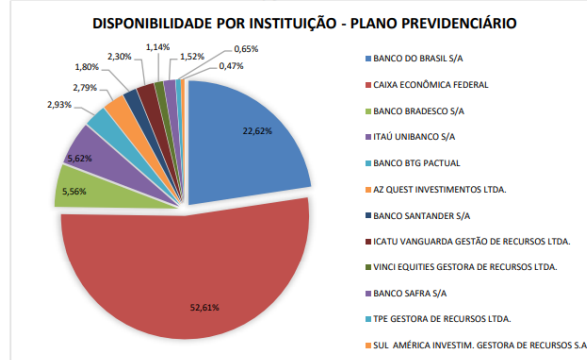
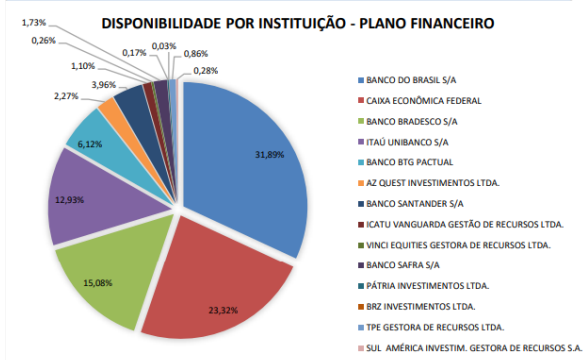
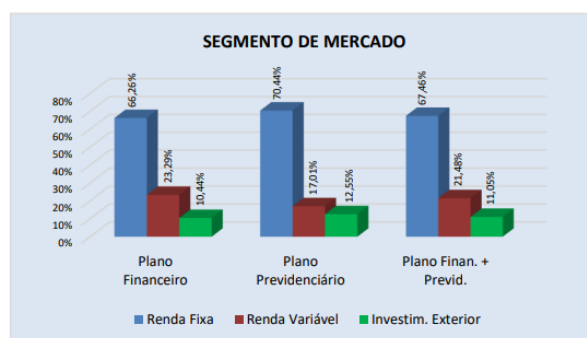
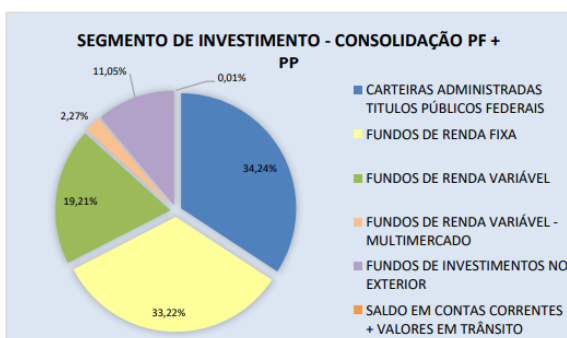
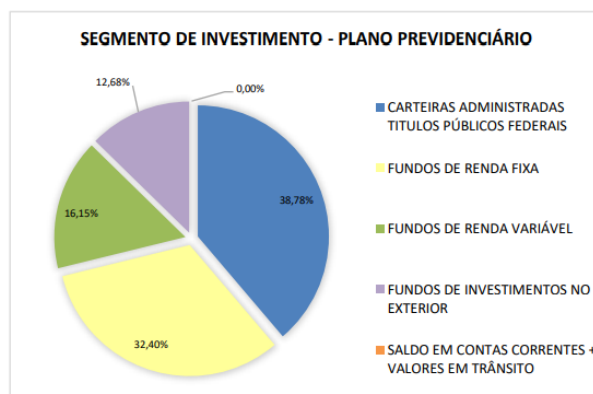
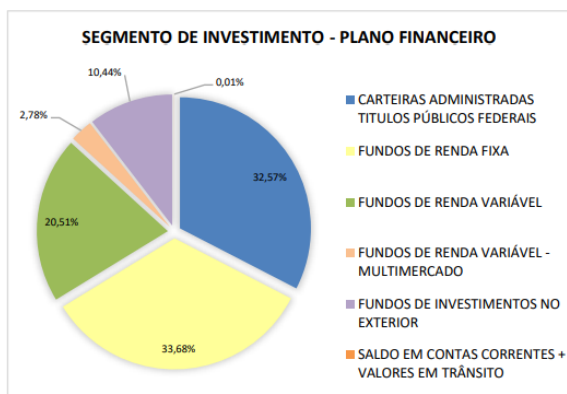
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	VALOR - R\$	PARTIC. - %
BDRX	107.802.973,01	6,66%
MSCI WORLD	66.589.742,49	4,12%
I.E. - LIVRE	28.623.880,86	1,77%
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	203.016.596,36	12,55%

DISPONIBILID. CONTA CORRENTE	VALOR - R\$	PARTIC. - %
Saldo Contas Correntes	1.667,64	0,00%

TOTAL GERAL	VALOR - R\$	PARTIC. - %
	1.617.704.253,05	100,00%

GRÁFICO ESTRATÉGIA DOS PRODUTOS DE INVESTIMENTOS DO PLANO PREVIDENCIÁRIO





O mês de dezembro de 2021 manteve a frustração em relação à meta verificada nos meses anteriores, mas com evidente fechamento positivo, especialmente quando considerado todo o período:

JANEIRO DE 2021						
PLANO FINANCEIRO						
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%
CARTEIRAS ADMINISTRADAS DE TÍTULOS PUB. FED.	1.675.137.923,95	1.573.239.706,17	1.573.369.983,85	-13.670.461,92	1.661.337.184,35	-0,816143
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.187.419.596,70	31.981.080,85	24.489.238,73	-8.969.641,03	1.185.941.797,79	-0,750653
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	741.319.329,75	156.801,44	0,00	-20.231.232,85	721.244.898,34	-2,728508
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	54.998.818,39	0,00	0,00	-113.519,10	54.885.299,29	-0,206403
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	121.832.920,29	0,00	0,00	6.603.901,61	128.436.821,90	5,420457
TOTAIS - PLANO FINANCEIRO	3.780.708.589,08	1.605.377.588,46	1.597.859.222,58	-36.380.953,29	3.751.846.001,67	-0,960369
PLANO PREVIDENCIÁRIO						
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%
CARTEIRAS ADMINISTRADAS DE TÍTULOS PUB. FED.	533.486.698,95	3.856.688,10	4.111.806,00	-78.341,41	533.153.239,64	-0,014692
FUNDOS DE RENDA FIXA	544.376.681,22	15.912.641,91	15.973.732,22	-3.471.885,75	540.843.705,16	-0,637844
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	244.625.830,79	0,00	0,00	-6.523.529,14	238.102.301,65	-2,666738
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO						
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	4.876.454,60	0,00	0,00	282.202,92	5.158.657,52	5,787051
TOTAIS - PLANO PREVIDENC.	1.327.365.665,56	19.769.330,01	20.085.538,22	-9.791.553,38	1.317.257.903,97	-0,737844
CARTEIRA TOTAL - PF + PP	5.108.074.254,64	1.625.146.918,47	1.617.944.760,80	-46.172.506,67	5.069.103.905,64	-0,902640

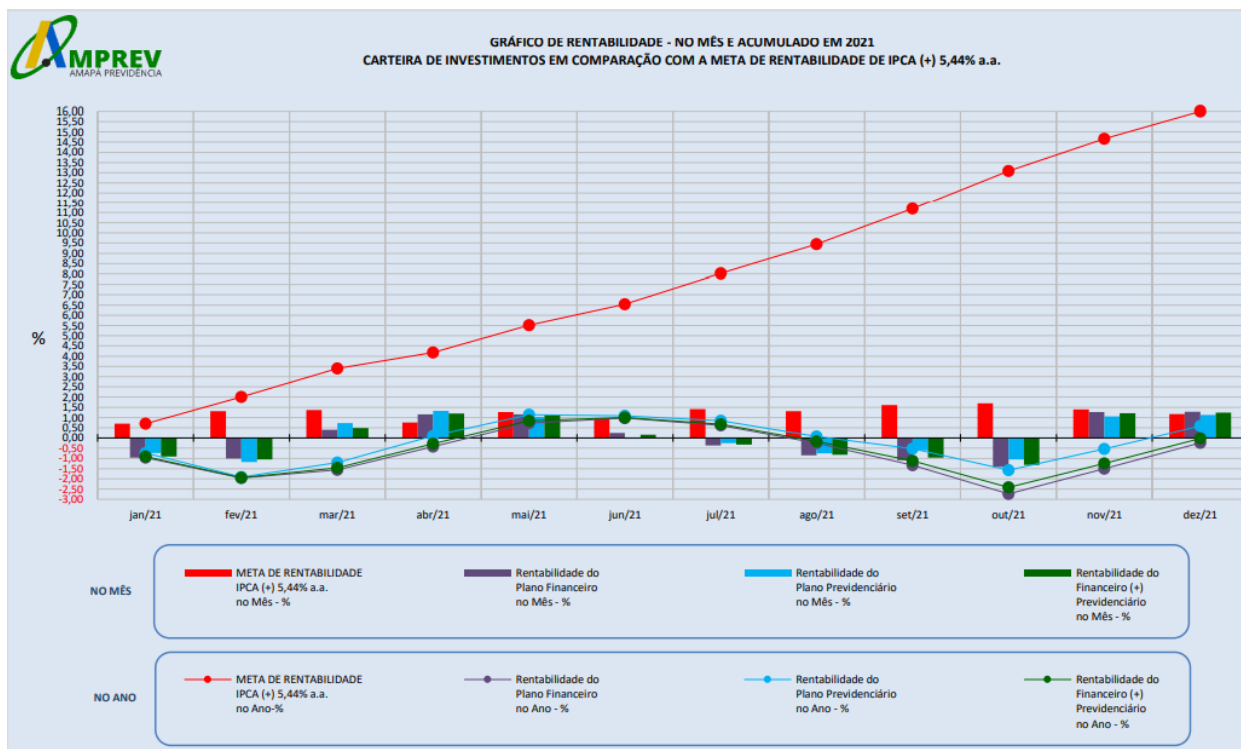
FEVEREIRO DE 2021						
PLANO FINANCEIRO						
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%
CARTEIRAS ADMINISTRADAS DE TÍTULOS PUB. FED.	1.661.337.184,35	1.544.485.964,18	1.544.612.695,89	-23.036.408,72	1.638.174.043,92	-1,386724
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.185.941.797,79	25.786.156,97	22.518.554,40	-15.656.102,71	1.173.553.297,65	-1,316514
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	721.244.898,34	0,00	0,00	-4.810.948,61	716.433.949,73	-0,667034
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	54.885.299,29	0,00	0,00	700.051,50	55.585.350,79	1,275481
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	128.436.821,90	0,00	0,00	5.034.004,55	133.470.826,45	3,919440
TOTAIS - PLANO FINANCEIRO	3.751.846.001,67	1.570.272.121,15	1.567.131.250,29	-37.769.403,99	3.717.217.468,54	-1,005846
PLANO PREVIDENCIÁRIO						
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%
CARTEIRAS ADMINISTRADAS DE TÍTULOS PUB. FED.	533.153.239,64	29.895.556,43	34.602.278,75	-3.973.421,68	524.473.095,64	-0,751906
FUNDOS DE RENDA FIXA	540.843.705,16	60.857.682,90	26.543.104,24	-6.418.926,37	568.739.357,45	-1,116028
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	238.102.301,65	0,00	0,00	-5.719.180,75	232.383.120,90	-2,401985
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO						
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	5.158.657,52	0,00	0,00	182.958,09	5.341.615,61	3,546622
TOTAIS - PLANO PREVIDENC.	1.317.257.903,97	90.753.239,33	61.145.382,99	-15.928.570,71	1.330.937.189,60	-1,182640
CARTEIRA TOTAL - PF + PP	5.069.103.905,64	1.661.025.360,48	1.628.276.633,28	-63.897.974,70	5.048.154.658,14	-1,062619

MARÇO DE 2021						
PLANO FINANCEIRO						
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%
CARTEIRAS ADMINISTRADAS DE TÍTULOS PUB. FED.	1.638.174.043,92	2.190.401.860,36	2.190.510.571,33	-9.064.167,49	1.629.001.165,46	-0,553346
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.173.553.297,65	26.207.344,06	54.950.216,50	-6.933.400,39	1.137.877.024,82	-0,605637
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	716.433.949,73	19.987.320,48	26.893.066,18	23.504.832,86	733.033.036,89	3,312741
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	55.585.350,80	8.919.075,50	21.371.112,43	1.686.890,90	44.820.204,77	3,910877
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	133.470.826,45	39.345.105,11	0,00	5.843.977,87	178.659.909,43	3,381620
TOTAIS - PLANO FINANCEIRO	3.717.217.468,55	2.284.860.705,51	2.293.724.966,44	15.038.133,75	3.723.391.341,37	0,405521
PLANO PREVIDENCIÁRIO						
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%
CARTEIRAS ADMINISTRADAS DE TÍTULOS PUB. FED.	524.473.095,64	95.902.703,22	95.842.431,63	1.254.128,27	525.787.495,50	0,239094
FUNDOS DE RENDA FIXA	568.739.357,45	16.881.066,55	91.388.352,77	-2.204.369,29	492.027.701,94	-0,446019
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	232.383.120,90	0,00	4.337.577,55	7.941.151,41	235.986.694,76	3,482266
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO						
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	5.341.615,61	84.337.577,55	0,00	2.658.179,99	92.337.373,15	2,964099
TOTAIS - PLANO PREVIDENC.	1.330.937.189,60	197.121.347,32	191.568.361,95	9.649.090,38	1.346.139.265,35	0,721972
CARTEIRA TOTAL - PF + PP	5.048.154.658,15	2.481.982.052,83	2.485.293.328,39	24.687.224,13	5.069.530.606,72	0,489356

ABRIL DE 2021						
PLANO FINANCEIRO						
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%
CARTEIRAS ADMINISTRADAS DE TÍTULOS PUB. FED.	1.629.001.165,46	1.906.091.064,35	1.906.221.212,70	8.079.401,06	1.636.950.418,17	0,496012
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.137.877.024,82	457.328.454,90	457.173.152,48	7.005.287,24	1.145.037.614,48	0,615561
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	733.033.036,89	65.726.737,09	74.605.276,70	24.412.256,94	748.566.754,22	3,371139
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	44.820.204,77	34.915.432,43	0,00	2.388.907,84	82.124.545,04	2,996035
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	178.659.909,43	71.463.580,66	49.554.201,31	1.633.778,66	202.203.067,44	0,814571
TOTAIS - PLANO FINANCEIRO	3.723.391.341,37	2.535.525.269,43	2.487.553.843,19	43.519.631,74	3.814.882.399,35	1,153950
PLANO PREVIDENCIÁRIO						
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%
CARTEIRAS ADMINISTRADAS DE TÍTULOS PUB. FED.	525.787.495,50	77.255.353,29	38.256.735,69	6.286.081,89	571.072.194,99	1,113002
FUNDOS DE RENDA FIXA	492.027.701,94	112.340.311,46	168.134.316,76	2.554.508,16	438.788.204,80	0,585582
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	235.986.694,76	39.064.173,47	45.986.240,39	7.474.192,10	236.538.819,94	3,262918
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO						
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	92.337.373,15	51.103.076,14	25.445.662,83	1.505.140,69	119.499.927,15	1,275599
TOTAIS - PLANO PREVIDENC.	1.346.139.265,35	279.762.914,36	277.822.955,67	17.819.922,84	1.365.899.146,88	1,321875
CARTEIRA TOTAL - PF + PP	5.069.530.606,72	2.815.288.183,79	2.765.376.798,86	61.339.554,58	5.180.781.546,23	1,198169

MAIO DE 2021						
PLANO FINANCEIRO						
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%
CARTEIRAS ADMINISTRADAS DE TÍTULOS PUB. FED.	1.636.950.418,17	2.003.626.883,88	2.044.944.472,12	11.297.864,75	1.608.930.494,68	0,708037
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.145.037.614,48	58.850.950,38	224.064.538,58	7.921.444,12	987.745.470,40	0,808456
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	748.688.754,22	99.847.571,81	20.840.062,63	31.918.953,17	859.693.188,37	3,855997
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	82.124.545,04	0,00	0,00	380.834,42	82.485.379,46	0,439375
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	202.203.067,44	128.554.201,31	0,00	-7.313.502,55	321.443.768,20	-2,224590
TOTAIS - PLANO FINANCEIRO	3.814.882.399,35	2.288.879.607,16	2.289.849.103,33	44.185.393,81	3.858.298.297,09	1,158471
PLANO PREVIDENCIÁRIO						
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%
CARTEIRAS ADMINISTRADAS DE TÍTULOS PUB. FED.	571.072.194,99	94.287.072,84	108.508.549,11	4.069.688,51	580.922.405,23	0,730837
FUNDOS DE RENDA FIXA	438.788.204,80	28.945.952,94	26.216.467,81	3.580.808,00	443.078.497,93	0,810163
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	236.538.819,94	8.916.781,82	0,00	10.620.392,67	254.375.974,23	4,485579
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO						
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	119.499.927,15	25.445.662,83	0,00	-4.278.324,98	140.669.265,00	-2,950297
TOTAIS - PLANO PREVIDENC.	1.385.899.148,88	153.595.450,23	134.723.016,92	14.274.562,20	1.399.046.142,39	1,030824
CARTEIRA TOTAL - PF + PP	5.180.781.546,23	2.442.475.057,39	2.424.372.120,25	58.459.956,11	5.257.344.439,48	1,124471

JUNHO DE 2021							
PLANO FINANCEIRO							
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%	
CARTEIRAS ADMINISTRADAS DE TÍTULOS PUB. FED.	1.808.930.494,68	1.895.257.813,51	1.696.406.542,60	10.454.759,79	1.816.236.525,36	0,651070	
FUNDOS DE RENDA FIXA	987.745.470,40	585.670.640,43	549.401.113,40	3.235.673,92	1.027.250.871,35	0,315979	
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	859.893.186,37	37.050.716,51	0,00	3.301.473,55	900.045.376,43	0,368162	
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	82.485.379,48	0,00	0,00	2.225.050,10	84.710.429,58	2,697508	
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	321.443.766,20	42.000.000,00	0,00	-9.858.490,37	353.785.275,83	-2,657492	
TOTAIS - PLANO FINANCEIRO	3.858.298.297,00	2.359.979.170,45	2.245.807.656,00	9.558.466,99	3.982.028.278,53	0,240618	
PLANO PREVIDENCIÁRIO							
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%	
CARTEIRAS ADMINISTRADAS DE TÍTULOS PUB. FED.	580.922.405,23	459.729.041,74	435.259.715,40	-744.989,08	584.646.742,49	-0,127283	
FUNDOS DE RENDA FIXA	443.078.497,93	84.536.151,97	90.505.310,49	1.628.210,98	438.737.550,39	0,372496	
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	254.375.974,23	23.978.520,81	0,00	1.313.873,89	279.688.368,73	0,472015	
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO							
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	140.869.265,00	31.000.000,00	0,00	-2.900.504,70	188.788.760,30	-1,889589	
TOTAIS - PLANO PREVIDENC.	1.399.048.142,39	599.243.714,52	525.765.025,89	-703.409,11	1.471.821.421,91	-0,047769	
CARTEIRA TOTAL - PF + PP	5.257.344.439,48	2.959.222.884,97	2.771.572.681,89	8.855.057,88	5.453.849.700,44	0,162627	
JULHO DE 2021							
PLANO FINANCEIRO							
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%	
CARTEIRAS ADMINISTRADAS DE TÍTULOS PUB. FED.	1.816.236.525,36	445.298.796,97	445.452.310,49	-9.299.796,19	1.806.783.215,85	-0,575453	
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.027.250.871,35	81.423.433,62	89.737.008,55	-3.163.359,33	1.015.773.737,09	-0,310457	
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	900.045.376,43	15.000.000,00	0,00	-22.477.146,17	892.568.230,26	-2,468397	
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	84.710.429,58	0,00	0,00	2.203.470,40	86.913.899,98	2,601180	
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	353.785.275,83	0,00	0,00	18.304.529,67	372.089.805,50	5,173909	
TOTAIS - PLANO FINANCEIRO	3.982.028.278,53	541.722.230,59	535.189.319,04	-14.432.301,62	3.974.128.888,46	-0,361842	
PLANO PREVIDENCIÁRIO							
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%	
CARTEIRAS ADMINISTRADAS DE TÍTULOS PUB. FED.	584.646.742,49	13.529.999,67	13.549.064,07	-2.816.385,90	582.011.312,19	-0,447527	
FUNDOS DE RENDA FIXA	438.737.550,39	48.742.794,43	47.535.369,42	-1.201.094,60	438.743.880,80	-0,273010	
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	279.688.368,73	12.063.666,86	0,00	-9.815.473,60	282.116.561,99	-3,295995	
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO							
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	188.788.760,30	0,00	0,00	9.749.336,55	178.518.096,85	5,776742	
TOTAIS - PLANO PREVIDENC.	1.471.821.421,91	74.336.460,96	61.084.433,49	-3.883.597,55	1.481.389.851,83	-0,248041	
CARTEIRA TOTAL - PF + PP	5.453.849.700,44	616.058.691,55	596.273.752,53	-18.115.899,17	5.455.518.740,29	-0,339967	
AGOSTO DE 2021							
PLANO FINANCEIRO							
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%	
CARTEIRAS ADMINISTRADAS DE TÍTULOS PUB. FED.	1.806.783.215,85	756.409.991,42	765.024.296,07	-13.279.512,58	1.584.889.398,42	-0,830920	
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.015.773.737,09	45.049.406,78	24.401.154,03	-8.320.498,12	1.028.101.491,72	-0,802810	
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	892.568.230,26	0,00	0,00	-23.017.070,74	866.551.159,52	-2,578746	
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	86.913.899,98	0,00	0,00	2.899.947,99	88.813.847,95	3,338576	
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	372.089.805,50	0,00	0,00	7.849.380,72	379.939.186,22	2,106534	
TOTAIS - PLANO FINANCEIRO	3.974.128.888,46	801.459.398,20	789.425.450,10	-33.867.772,73	3.952.295.063,83	-0,849633	
PLANO PREVIDENCIÁRIO							
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%	
CARTEIRAS ADMINISTRADAS DE TÍTULOS PUB. FED.	582.011.312,19	202.034.861,68	227.422.869,89	-3.797.998,06	552.825.305,92	-0,682328	
FUNDOS DE RENDA FIXA	438.743.880,80	55.982.212,72	17.915.786,10	-3.067.280,07	473.743.027,35	-0,643291	
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	282.116.561,99	3.331.898,77	0,00	-8.362.938,16	277.085.522,80	-2,929754	
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO							
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	178.518.096,85	0,00	0,00	4.002.121,05	182.520.217,90	2,241857	
TOTAIS - PLANO PREVIDENC.	1.481.389.851,83	261.348.973,17	245.338.655,99	-11.228.095,24	1.486.174.073,77	-0,749706	
CARTEIRA TOTAL - PF + PP	5.455.518.740,29	1.062.808.371,37	1.034.764.106,09	-45.093.867,97	5.438.469.137,60	-0,822346	
SETEMBRO DE 2021							
PLANO FINANCEIRO							
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%	
CARTEIRAS ADMINISTRADAS DE TÍTULOS PUB. FED.	1.584.889.398,42	872.724.493,71	864.050.475,18	-2.601.835,42	1.590.961.581,53	-0,163272	
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.028.101.491,72	151.305.526,59	147.918.782,21	-694.817,91	1.030.793.418,19	-0,067361	
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	869.551.159,52	0,00	0,00	-37.858.557,73	831.692.601,79	-4,353805	
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	89.813.847,95	0,00	0,00	-4.137.280,06	85.676.567,89	-4,606506	
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	379.939.166,22	0,00	0,00	1.864.008,45	381.803.174,67	0,490607	
TOTAIS - PLANO FINANCEIRO	3.952.295.063,83	1.024.030.020,30	1.011.969.257,39	-43.428.482,67	3.920.927.344,07	-1,095474	
PLANO PREVIDENCIÁRIO							
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%	
CARTEIRAS ADMINISTRADAS DE TÍTULOS PUB. FED.	552.825.305,92	364.884.266,03	310.312.779,41	4.811.389,29	612.208.181,83	0,792133	
FUNDOS DE RENDA FIXA	473.743.027,35	113.859.832,72	142.595.436,52	-409.429,93	444.597.993,62	-0,092005	
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	277.085.522,80	1.325.970,49	0,00	-14.850.346,01	263.561.147,08	-5,333956	
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO							
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	182.520.217,90	0,00	0,00	1.254.599,37	183.774.817,27	0,687376	
TOTAIS - PLANO PREVIDENC.	1.486.174.073,77	480.070.069,24	452.908.215,93	-9.193.787,28	1.504.142.139,80	-0,607518	
CARTEIRA TOTAL - PF + PP	5.438.469.137,60	1.504.100.089,54	1.464.877.473,32	-62.622.269,95	5.425.069.483,87	-0,960665	



A análise dos rendimentos e da rentabilidade relativa indicam uma recuperação do cenário – apesar da frustração acumulada em relação à meta – com resultados significativamente mais positivos no plano financeiro (109,31% = R\$ - 4.312.985,83) quanto no previdenciário (95,77% = R\$ -792.426,70), confirmando a assertividade do CIAP no cumprimento das diretrizes estabelecidas na Política Anual de Investimentos. Abril e dezembro foram, ao final, os meses em que se alcançou a meta:

RENDIMENTO (R\$) EM COMPARAÇÃO COM O VALOR DA META DE RENTABILIDADE - R\$				
CARTEIRA CONSOLIDADA - PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO				
MÊS	Rendimento da Carteira Consolidada PF (+) PP - R\$	Meta de Rentabilidade IPCA (+) 5,44% a.a. no Mês - Em R\$	Rendimen. dos Planos (-) Valor da Meta de Rentabilidade - R\$	Rentabilidade Relativa em Relação a Meta de Rentabilidade - %
jan-21	-46.172.506,67	35.417.232,21	-81.589.738,88	-130,37
fev-21	-53.697.974,70	66.446.381,30	-120.144.356,00	-80,81
mar-21	24.687.224,13	69.237.097,35	-44.549.873,22	35,66
abr-21	61.339.554,58	38.517.624,94	22.821.929,64	159,25
mai-21	58.459.956,11	66.154.523,58	-7.694.567,47	88,37
jun-21	8.855.057,88	52.947.884,81	-44.092.826,93	16,72
jul-21	-18.115.899,17	76.760.981,53	-94.876.880,70	-23,60
ago-21	-45.093.867,97	71.966.049,53	-117.059.917,50	-62,66
set-21	-52.622.269,95	87.772.945,28	-140.395.215,23	-59,95
out-21	-71.707.019,81	92.454.757,43	-164.161.777,24	-77,56
nov-21	65.418.058,22	75.644.711,88	-10.226.653,66	86,48
dez-21	68.623.417,88	65.102.858,75	3.520.559,13	105,41
Acumulado	-26.269,47	798.423.048,60	-798.449.318,07	-0,15

Para exemplificar o detalhamento sobre os resultados, a ata do CIAP descreve a síntese da carteira no mês:

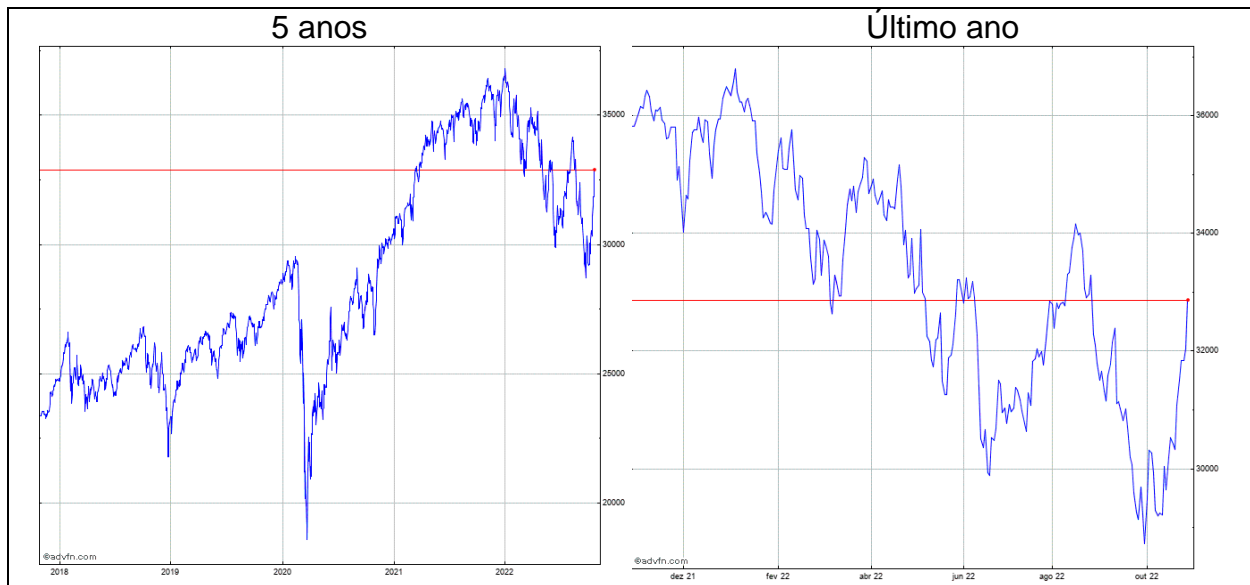
*Plano Financeiro fechou dezembro de 2021 com posição final de R\$ 4.004.036.387,11 (quatro bilhões, quatro milhões trinta e seis mil trezentos e oitenta e sete reais e onze centavos); Plano Previdenciário fechou dezembro de 2021 com posição final de R\$ 1.617.702.585,41 (um bilhão, seiscentos e dezessete milhões setecentos e dois mil quinhentos e oitenta e cinco reais e quarenta e um centavos) (fls.55). Rentabilidade da carteira e Meta de rentabilidade em dezembro de 2021: Plano Financeiro teve rentabilidade positiva de 1,28%; Plano Previdenciário teve rentabilidade positiva de 1,12%; a meta de rentabilidade do mês foi positiva de 1,17%, a consolidação de rentabilidade dos planos fechou positiva em 1,24% (fls.55). No demonstrativo de rendimento em comparação com o valor da meta de rentabilidade, que determina a relação percentual da carteira em relação a meta de rentabilidade, o plano financeiro está com menos 1,53% e o plano previdenciário de 3,66% no acumulado do ano em relação à meta de rentabilidade (fls.57), os índices do mercado que mostram o comportamento da carteira, os índices de renda fixa, somente o IMA-B 5 + fechou negativo, os índices de renda variável e de investimento no exterior, fecharam positivos (fls.60). Evolução dos recursos dos segurados do RPPS do Estado do Amapá (fls.62), a carteira da Amprev teve um rendimento líquido acumulado negativo de R\$ 26.269,47 (vinte e seis mil duzentos e sessenta e nove reais e quarenta e sete centavos). O coordenador Carlos Roberto Oliveira finalizou a apresentação, e a avaliação dos membros, foi que **a carteira reagiu bem no final do ano de 2021, apesar de alguns ativos puxarem a rentabilidade pra baixo, houve entrada de mais de quinhentos milhões de recurso de arrecadação, e a avaliação que o comitê está fazendo nos fundos da carteira por segmento e estratégia e criação de carteira com marcação na curva, diminuem a volatilidade e trará bons resultados no final de 2022** – (ata, fl. 66)*

Resultados mais positivos em relação à tendência anterior, mas ainda inferiores aos já observados neste ano de 2022, como será analisado futuramente neste COFISPREV. De toda a forma, o mês de dezembro de 2021 é um exemplo do dinamismo da performance da carteira e da subsequente necessidade de uma gestão ativa, postura que vem sendo adotada pelo CIAP.

Trata-se de acompanhar de forma ativa os mercados, as recomendações dos economistas e as políticas monetárias estabelecidas pelos bancos centrais brasileiro e internacionais para proteção constante do patrimônio da AMPREV:

Os gestores seguem com visão cautelosa para renda variável no curto prazo. O aumento das incertezas locais e globais motiva tal posicionamento. O resultado resiliente das empresas listadas e o crescimento global do PIB proporcionado pelo mundo pós Covid, são os fatores positivos. No local, risco político, inflação e risco fiscal permanecem como pontos de atenção. Já no global, a perspectiva de redução de liquidez, como reação a escalada da inflação e o impacto das novas variantes da COVID-19, são os principais riscos do momento. (Carta do Gestor RPPS–abril/2022, elaborado pela Bradesco Asset Management - BRAM)

Em dezembro de 2021, os mercados internacionais continuaram demonstrando retomada, conforme exemplifica gráfico abaixo, ainda longe do movimento mais intenso que vem ocorrendo em 2022:



Fonte: <https://br.advfn.com/bolsa-de-valores/dow/dji/grafico>

Registra-se ainda o acompanhamento do COFISPREV nas reuniões do CIAP e diálogos com as instituições que compõem a carteira para tais movimentações e aplicações, reforçando a governança da gestão dos recursos da AMPREV.

Assim, considerando a observância da diretrizes e princípios contidos na Política Anual de Investimentos, aprovada pelo Conselho Estadual de Previdência–CEP, e legislação específica em vigor, definidas pela Resolução Nº 4.963/2021-CMN e Portaria MPS nº 519/2011, bem como da postura proativa para proteção do patrimônio da AMPREV, em que pese a meta de rentabilidade, especialmente em função do contexto econômico desafiador, voto pela aprovação do demonstrativo mensal referente ao mês de dezembro de 2021.

Adicionalmente, considerando a sistemática recentemente adotada pelo CIAP e fluxo de compartilhamento com este COFISPREV, recomenda-se ainda o compartilhamento do relatório periódico a ser apresentado de acordo com a regulamentação vigente, após apreciação por este conselho, para que os segurados e demais interessados possam acompanhar por meio do portal da AMPREV.

É o voto que expresse a este Conselho Fiscal da AMPREV.

Macapá-AP, 31/10/2022.

EDUARDO CORRÊA TAVARES
Conselheiro Relator

Este relatório foi submetido para apreciação na décima reunião ordinária realizada, no dia 31/10/2022, sendo aprovado por unanimidade, pelos demais membros titulares do Conselho Fiscal da Amapá Previdência - COFISPREV, conforme abaixo.

Elionai Dias da Paixão - Conselheiro Titular/Presidente

Helton Pontes da Costa - Conselheiro Titular/Vice-Presidente
Arnaldo Santos Filho - Conselheiro Titular
Adriene Ribeiro Benjamin Pinheiro - Conselheira Titular
Francisco das Chagas Ferreira Feijó – Conselheiro Titular



Cód. verificador: 123001867. Cód. CRC: 99C5457
Documento assinado eletronicamente por **EDUARDO CORRÊA TAVARES** em 27/12/2022 16:00, **ADRIENE RIBEIRO BENJAMIN PINHEIRO** em 27/12/2022 14:54 e outros, conforme decreto nº 0829/2018. A autenticidade do documento pode ser conferida no site: <https://sigdoc.ap.gov.br/autenticador>

