

ANÁLISE TÉCNICA Nº 016/2023–COFISPREV/AMPREV.

PROCESSO: 2022.277.901604PA.

OBJETO: Demonstrativo de Consolidação dos Ativos da Carteira de Investimentos da AMPREV, do mês de julho/2022.

INTERESSADOS: Diretoria Executiva e Conselho Estadual de Previdência – CEP.

CONSELHEIRO RELATOR: Helton Pontes da Costa

Relatório

1. Trata-se de análise dos **autos do processo nº 2022.277.901604PA**, cujo objeto versa sobre **Demonstrativo de Consolidação dos Ativos da Carteira de Investimentos da Amapá Previdência, competência julho de 2022**.

2. Os autos foram encaminhados para minha relatoria, recebidos em mídia digital, em 1 arquivo em PDF, contendo **69 páginas. Não consta** nesses autos digitais: a **ATA** (que deliberou sobre esses demonstrativos), o **RELATÓRIO** detalhado com informações sobre rentabilidade, riscos das aplicações e os **EXTRATOS FINANCEIROS DAS APLICAÇÕES**.

3. Consta às **fls. 4-60** dos **autos, os demonstrativos de consolidação dos ativos da carteira de investimentos dos recursos dos segurados do RPPS do Estado do Amapá, do mês de julho de 2022, em planilhas, com posição final no mês do Plano Financeiro e Plano Previdenciário, em cada produto de investimentos**.

4. Às fls. **65** dos **autos**, consta Certidão de Deliberação, da lavra do Sr. CARLOS ROBERTO DOS ANJOS (Coordenador e Membro do CIAP/AMPREV) e da Srª FRANCISCA DA SILVA CRUZ (Secretária do CIAP/AMPREV), a informar que o Comitê de Investimentos da Amapá Previdência (CIAP/AMPREV) **DELIBEROU, POR UNANIMIDADE, APROVAR os demonstrativos de consolidação dos ativos da carteira de investimentos dos**

recursos dos segurados do RPPS do Estado do Amapá, do mês de julho de 2022, processo nº 2022.277.901604PA, conforme 16ª Reunião Ordinária, realizada em 29 de agosto de 2022.

5. É o breve relatório.

Manifestação

Do Recebimento dos Autos

6. Consigno que os presentes autos foram encaminhados inicialmente ao distinto ex-Conselheiro Eduardo Correia Tavares, que foi exonerado em virtude de imperativo legal, eis que exercia cargo comissionado, função de ser Secretário de Estado, deixando-o de exercer a partir de 01 de janeiro de 2023. Em virtude disso, foram reencaminhados para a minha relatoria.

Da Competência do Conselho Fiscal da AMPREV

7. Frise-se que a presente manifestação tem como objetivo dar conformidade legal aos atos da Diretoria Administrativa e demais prepostos com relação a aplicação de recursos no mercado financeiro, de acordo com o art. 106, da Lei Estadual n. 0915/2005, e art. 2º, inc. VII, do Regimento Interno do Conselho Fiscal da AMPREV.

Da Competência do Comitê de Investimentos da AMPREV (CIAP/AMPREV)

8. O Comitê de Investimentos da Amapá Previdência, constituído em conformidade com o disposto no Art. 3º-A, § 1º, alíneas “a” a “e” e Art. 6º, §§ 3º a 6º, da Portaria MPS nº 519/2011 e suas alterações (revogada pela Portaria n. 1.467, de 2 de junho de 2022, em vigor a partir de julho/2022), tem como finalidade assessorar o Conselho Estadual de Previdência–CEP na

formulação da Política de Investimentos e a Diretoria Executiva na execução dessa política.

9. A atuação do CIAP/AMPREV está estabelecida na Política Anual de Investimentos para o exercício de 2022, tendo como um dos seus objetivos estabelecer a **estratégia de alocação dos recursos** entre os diversos segmentos de aplicação e as respectivas carteiras de investimentos, bem como **fixar os parâmetros de rentabilidade perseguidos**, que deverão buscar compatibilidade com o perfil de suas obrigações, tendo em vista a necessidade de busca e manutenção do **equilíbrio financeiro e atuarial e os limites de diversificação e concentração** previstos na Resolução CMN Nº 4.963/2021, entre outros.

10. Em 21/02/2023, este Conselheiro Relator realizou consulta no sítio eletrônico da Amapá Previdência (<https://amprev.ap.gov.br/atas>), momento que foi possível constatar a existência e disponibilização para download da **ATA DA 16ª REUNIÃO ORDINÁRIA**, do CIAP/AMPREV, que aprovou esse demonstrativo.

11. Nesta esteira pode-se aferir, desde logo, que no tocante a publicidade desse instrumental o Comitê de Investimento da Instituição está a cumprir o princípio da publicidade, conforme *caput do art. 37*, da Constituição Federal de 1988, disponibilizando informações sensíveis para o controle social.

A carteira e suas aplicações

12. Entende esse relator que a análise pelo Conselho Fiscal do objeto desses autos circunscreve, principalmente, para aferir se a Carteira de Investimento foi debatida, discutida e aprovada pelo órgão específico da Instituição, qual seja: o Comitê de Investimentos da AMPREV. Nesse sentido,

muito embora não conste nesses autos, foi possível realizar o download da ATA que o aprovou, da qual peço vênha para transcrever trechos, posto que é esclarecedora da situação dos ativos e da atuação desse nobre colegiado, vejamos:

1 **ATA DA DÉCIMA SEXTA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE**
2 **INVESTIMENTOS DA AMAPÁ PREVIDÊNCIA – CIAP DO ANO 2022.**

12 **04: Apresentação para deliberação do Demonstrativo de consolidação dos ativos da**
13 **carteira de investimentos dos recursos dos segurados dos RPPS do Estado do**
14 **Amapá, competência julho de 2022, em cumprimento a Resolução CMN nº 4.963/21,**
15 **Portaria MPS nº 519/11 e Política Anual de Investimentos do RPPS do exercício de**
16 **2022.** O coordenador Carlos Roberto Oliveira apresentou o demonstrativo de forma
17 resumida. **Plano Financeiro (fls.03/20).** No segmento de renda fixa: As carteiras
18 administradas de títulos públicos federais, com marcação a mercado, de gestão do Banco
19 do Brasil, BTG Pactual e Caixa Econômica, fecharam com posição final de R\$
20 1.350.442.588,04 (um bilhão trezentos e cinquenta milhões quatrocentos e quarenta e dois
21 mil, quinhentos e oitenta e oito reais e quatro centavos) e rendimento líquido negativo de
22 R\$ 9.308.742,78 (nove milhões trezentos e oito mil setecentos e quarenta e dois reais e
23 setenta e oito centavos), a carteira administrada de títulos públicos federais, com
24 marcação na curva, do Banco BTG Pactual, houve uma deliberação do Comitê de
25 investimentos, de aplicação de R\$ 300 milhões em títulos públicos federais, o qual foi
26 comprado R\$ 299.819.773,50 (duzentos e noventa e nove milhões oitocentos e dezenove
27 mil setecentos e setenta e três reais e cinquenta centavos) o saldo da deliberação ficou
28 aplicado no fundo BTG PACTUAL TESOUREIRO SELIC RF REF. DI, a carteira fechou
29 com posição final de R\$ 721.020.096,42 (setecentos e vinte e um milhões vinte mil,
30 noventa e seis reais e quarenta e dois centavos) e rendimento líquido positivo de R\$
31 3.600.221,09 (três milhões seiscentos mil duzentos e vinte e um reais e nove centavos), o
32 coordenador observou, que o IPCA de julho foi negativo em 0,68%, mas a rentabilidade

33 foi positiva, mas a carteira vai se ajustar no próximo mês e pode aparecer negativo, mas
34 os membros ressaltaram, que no ano fechado a carteira não terá perda, nos fundos de
35 renda fixa, houve movimentações, sendo: resgate de R\$ 100 milhões do fundo FI CAIXA
36 BRASIL RF REF. DI LP, para compra de títulos públicos federais com marcação na curva
37 de juros, resgate de R\$ 228 milhões, do fundo BB PREV. FLUXO RF SIMPLES FIC FI,
38 para compra de títulos públicos federais com marcação na curva de juros, resgate de R\$
39 225 milhões, do fundo ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FIC FI, para compra de
40 letras financeiras emitidas pelos bancos Itaú e Santander e de títulos públicos com
41 marcação na curva de juros, aplicação e resgate de R\$ 299 milhões do fundo BTG
42 PACTUAL TESOURO SELIC RF REF. DI, para compra de títulos públicos federais com
43 marcação na curva de juros, resgate de R\$ 125 milhões, do fundo BRADESCO FI RF
44 REF. DI FEDERAL EXTRA, para compra de letras financeiras e títulos públicos federais
45 com marcação na curva de juros, resgate de R\$ 25 milhões do fundo SANTANDER RF
46 REF. DI INST. PREMIUM FIC FI, para compra de letras financeiras, os fundos de renda
47 fixa fecharam com posição final de R\$ 1.569.616.827,69 (um bilhão quinhentos e
48 sessenta e nove milhões seiscentos e dezesseis mil oitocentos e vinte e sete reais e sessenta
49 e nove centavos) e rendimento líquido positivo de R\$ 8.749.794,27 (oito milhões
50 setecentos e quarenta e nove mil setecentos e noventa e quatro reais e vinte e sete
51 centavos), as letras financeiras emitidas pelos Bancos BRADESCO, SANTANDER,
52 ITAÚ e BTG PACTUAL, fecharam com posição final de R\$ 214.313.386,35 (duzentos
53 e catorze milhões trezentos e treze mil trezentos e oitenta e seis reais e trinta e cinco
54 centavos) e rendimento líquido positivo de R\$ 1.379.927,48 (um milhão trezentos e
55 setenta e nove mil novecentos e vinte e sete reais e quarenta e oito centavos), os fundos
56 de renda variável, fecharam com posição final de R\$ 179.391.867,96 (cento e setenta e
57 nove milhões trezentos e noventa e um mil oitocentos e sessenta e sete reais e noventa e
58 seis centavos), e rendimento líquido positivo de R\$ 8.923.287,43 (oito milhões
59 novecentos e vinte e três mil duzentos e oitenta e sete reais e quarenta e três centavos), os
60 fundos de investimentos estruturados FIP'S e multimercado, o coordenador observou,
61 que o FIP TERRAS BRASIL – MULTISTRATEGIA foi liquidado em julho e teve
62 rendimento líquido negativo de R\$ 243.620,48 (duzentos e quarenta e três mil seiscentos

63 e vinte reais e quarenta e oito centavos) e amortização aos cofres da AMPREV de R\$
64 860.614,71 (oitocentos e sessenta mil seiscentos e catorze reais e setenta e um centavos)
65 os fundos de investimentos estruturados FIP'S e multimercado fecharam com posição
66 final de R\$ 97.994.930,60 (noventa e sete milhões novecentos e noventa e quatro mil
67 novecentos e trinta reais e sessenta centavos) e rendimento líquido negativo de R\$
68 259.698,81 (duzentos e cinquenta e nove mil seiscentos e noventa e oito reais e oitenta e
69 um centavos), os fundos de investimentos no exterior, conforme deliberação do Comitê
70 de Investimentos, em julho foram realizados os resgates totais de todos os fundos de
71 investimentos no exterior, mas o Bradesco não executou a solicitação do fundo
72 BRADESCO INST. FI AÇÕES BDR NIVEL I, a explicação do banco Bradesco, foi
73 devido às várias movimentações solicitadas pela AMPREV, o que pode ter confundido à
74 não execução do resgate, mas a execução foi realizada em agosto e não gerou prejuízo à
75 AMPREV, os fundos de investimentos no exterior fecharam com posição final de R\$
76 2.868.302,12 (dois milhões oitocentos e sessenta e oito mil trezentos e dois reais e doze
77 centavos) e rendimento líquido positivo de R\$ 7.661.682,49 (sete milhões seiscentos e
78 sessenta e um mil seiscentos e oitenta e dois reais e quarenta e nove centavos). **Plano**
79 **Previdenciário (fls.21/35):** A carteira administrada de títulos públicos federais, marcada
80 a mercado, da Caixa Econômica, fechou com posição final de R\$ 661.103.621,89
81 (seiscentos e sessenta e um milhões cento e três mil seiscentos e vinte e um reais e oitenta
82 e nove centavos) e rendimento líquido positivo de R\$ 392.401,77 (trezentos e noventa e
83 dois mil, quatrocentos e um reais e setenta e sete centavos), a carteira administrada de
84 títulos públicos federais, com marcação na curva, do Banco BTG Pactual, fechou com
85 posição final de R\$ 299.743.300,47 (duzentos e vinte e nove milhões setecentos e
86 quarenta e três mil, trezentos reais e quarenta e sete centavos) e rendimento líquido
87 positivo de R\$ 840.484,29 (oitocentos e quarenta mil quatrocentos e oitenta e quatro reais
88 e vinte e nove centavos), nos fundos de renda fixa, houve movimentações, sendo: resgate
89 de R\$ 365.196.482,71(trezentos e sessenta e cinco milhões cento e noventa e seis mil
90 quatrocentos e oitenta e dois reais e setenta e um centavos) do fundo BB PREV. FLUXO
91 RF SIMPLES FIC FI, para compra de títulos públicos federais com marcação na curva

92 de juros do Banco BTG Pactual e saldo foi aplicação no fundo BB PREV.RF REF. DI LP
93 PERFIL FIC FI, resgate de R\$ 304.931.252,73 (trezentos e quatro milhões novecentos e
94 trinta e um mil duzentos e cinquenta e dois reais e setenta e três centavos) do fundo BTG
95 PACTUAL TESOIRO SELIC RF REF. DI, para compra de títulos públicos federais com
96 marcação na curva de juros do banco BTG Pactual, resgate de R\$ 25 milhões, do fundo
97 BRADESCO FI RF REF. DI FEDERAL EXTRA, para compra de letras financeiras da
98 própria instituição e aplicação de R\$ 12.262.189,10 (doze milhões duzentos e sessenta e
99 dois mil cento e oitenta e nove reais e dez centavos) no fundo SANTANDER RF REF.
100 DI INST. PREMIUM FIC FI, oriundo do resgate total do fundo de investimento no
101 exterior SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLAR MASTER MM IE FI, os fundos
102 de renda fixa fecharam com posição final de R\$ 651.685.450,35 (seiscentos e cinquenta
103 e um milhões seiscentos e oitenta e cinco mil quatrocentos e cinquenta reais e trinta e
104 cinco centavos) e rendimento líquido positivo de R\$ 3.960.688,43 (três milhões
105 novecentos e sessenta mil seiscentos e oitenta e oito reais e quarenta e três centavos), as
106 letras financeiras emitidas pelos Bancos BRADESCO, SANTANDER e BTG
107 PACTUAL, fecharam com posição final de R\$ 105.017.554,11 (cento e cinco milhões
108 dezessete mil quinhentos e cinquenta e quatro reais e onze centavos) e rendimento líquido
109 positivo de R\$ 859.051,55 (oitocentos e cinquenta e nove mil cinquenta e um reais e
110 cinquenta e cinco centavos), os fundos de renda variável fecharam com posição final de
111 R\$ 88.820.237,90 (oitenta e oito milhões oitocentos e vinte mil duzentos e trinta e sete
112 reais e noventa centavos) e rendimento líquido positivo de R\$ 4.045.478,90 (quatro
113 milhões quarenta e cinco mil quatrocentos e setenta e oito reais e noventa centavos), os
114 fundos de investimentos estruturados FIP'S e multimercado, fecharam com posição final
115 de R\$ 42.156.112,15 (quarenta e dois milhões cento e cinquenta e seis mil cento e doze
116 reais e quinze centavos) e rendimento líquido positivo de R\$ 142.519,96 (cento e quarenta
117 e dois mil quinhentos e dezenove reais e noventa e seis centavo), os fundos de
118 investimentos no exterior, conforme deliberação do Comitê de Investimentos, em julho
119 foram realizados os resgates totais de todos os fundos de investimentos no exterior de R\$
120 59.539.573,50 (cinquenta e nove milhões quinhentos e trinta e nove mil quinhentos e
121 setenta e três reais e cinquenta centavos), com rendimento líquido positivo de R\$

122 4.046.308,43 (quatro milhões quarenta e seis mil trezentos e oito reais e quarenta e três
123 centavos). Em seguida, o coordenador apresentou o resumo da consolidação dos ativos
124 da carteira (fls.36/56): Plano Financeiro fechou julho de 2022, com posição final de R\$
125 4.135.647.999,18 (quatro bilhões, cento e trinta e cinco milhões seiscientos e quarenta e
126 sete mil novecentos e noventa e nove reais e dezoito centavos); Plano Previdenciário
127 fechou julho de 2022 com posição final de R\$ 1.848.526.276,87 (um bilhão oitocentos e
128 quarenta e oito milhões quinhentos e vinte e seis mil duzentos e setenta e seis reais e
129 oitenta e sete centavos) (fls.50). Rentabilidade da carteira e Meta de rentabilidade em
130 julho de 2022: Plano Financeiro teve rentabilidade positiva de 0,50%; Plano
131 Previdenciário teve rentabilidade positiva de 0,77%; a meta de rentabilidade do mês foi
132 negativa de 0,23%, a consolidação de rentabilidade dos planos fechou positiva em 0,58%
133 (fls.51). No demonstrativo de rendimento em comparação com o valor da meta de
134 rentabilidade, que determina a relação percentual relativa da carteira em relação a meta
135 de rentabilidade, o plano financeiro está com 23,83% e o plano previdenciário de 35,94%
136 no acumulado do ano, em relação à meta de rentabilidade (fls.52), os índices do mercado
137 que mostram o comportamento da carteira, os índices de renda fixa IMA B e IMA B +,
138 fecharam negativos, os índices de renda variável e de investimento no exterior, fecharam
139 positivos (54). Evolução dos recursos dos segurados do RPPS do Estado do Amapá
140 (fls.56), a carteira da Amprev teve um rendimento líquido acumulado positivo de R\$
141 126.969.346,26 (cento e vinte e seis milhões novecentos e novecentos e sessenta e nove
142 mil trezentos e quarenta e seis reais e vinte e seis centavos). O coordenador Carlos
143 Roberto Oliveira finalizou a apresentação, em seguida, o coordenador colocou o
144 demonstrativo de investimentos, competência julho de 2022, para deliberação dos
145 membros, o qual foi aprovado por unanimidade. **Item 5: Avaliação da carteira de**

A par dessas informações podemos observar que houve resgaste elevados em alguns fundos de aplicações financeiras, o que no entender desse relator é deveras importante o convite ao coordenador do CIAP para em uma oportuna reunião demonstrar a razoabilidade dessas ações.



13. Das informações dos demonstrativos:

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, sendo assim trago ao conhecimento alguns fragmentos do demonstrativos do mês, nestes termos:

RESUMO DA DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - PLANO FINANCEIRO E PLANO PREVIDENCIÁRIO										
SEGMENTO DE INVESTIMENTO	SEGMENTO DE MERCADO	PLANO FINANCEIRO - PF			PLANO PREVIDENCIÁRIO - PP			DISPONIBILIDADE TOTAL - PF + PP		
		Saldo (R\$)	Particip. (%)	Rendim. Liq.-R\$	Saldo (R\$)	Particip. (%)	Rendim. Liq.-R\$	Saldo (R\$)	Part. (%)	Rendim. Liq.-R\$
CARTEIRAS ADMINISTRADAS TIT. PUB. FEDERAIS - A MERCADO	Renda Fixa	1.350.442.588,04	32,85%	-9.308.742,78	661.103.621,89	35,76%	392.401,77	2.011.546.209,93	33,61%	-8.916.341,01
CARTEIRAS ADMINISTRADAS TIT. PÚB. FEDERAIS - NA CURVA	Renda Fixa	721.020.096,42	17,43%	3.600.221,09	299.743.300,47	16,22%	840.484,33	1.020.763.396,89	17,08%	4.440.705,42
FUNDOS DE RENDA FIXA	Renda Fixa	1.569.616.827,69	37,95%	8.749.794,27	651.685.450,35	35,25%	3.960.888,43	2.221.302.278,04	37,12%	12.710.482,70
ATIVOS FINANCEIRO DE R.F. EMITIDOS POR INST. FINANC.	Renda Fixa	214.313.386,35	5,18%	1.379.927,48	105.017.554,11	5,88%	859.051,55	319.330.940,46	5,34%	2.238.979,03
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	Renda Variável	179.391.887,96	4,34%	8.923.287,43	88.820.237,90	4,80%	4.045.478,90	268.212.105,86	4,48%	12.968.766,33
FUNDOS DE INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	Investim. Estruturados	97.994.930,60	2,37%	-259.698,81	42.156.112,15	2,28%	142.519,96	140.151.042,75	2,34%	-117.178,85
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Investimentos Exterior	2.868.302,12	0,07%	7.661.682,49	0,00	0,00%	4.048.308,43	2.868.302,12	0,05%	11.707.990,92
SUBTOTAL - SOMENTE RECURSOS APLICADOS		4.135.647.999,18		20.746.471,17	1.848.526.276,87		14.286.933,37	5.984.174.276,05		35.033.404,54
SALDO EM CONTAS CORRENTES + VALORES EM TRÂNSITO		153.782,29	0,00%		924,31	0,00%		154.706,60	0,00%	
TOTAIS		4.135.801.781,47	100,00%	20.746.471,17	1.848.527.201,18	100,00%	14.286.933,37	5.984.328.982,65	100,00%	35.033.404,54

RESUMO DA DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - Produtos de Investimento e Saldo de Contas Correntes

INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	PLANO FINANCEIRO - PF				PLANO PREVIDENCIÁRIO - PP				DISPONIBILID. TOTAL - PF + PP	
	Aplicações - R\$	Saldo C/C+VT - R\$	Total Instituiç.-R\$	Particip. %	Aplicações - R\$	Saldo C/C+VT - R\$	Total Instituiç.-R\$	Particip. %	Total Institui.-R\$	Particip. %
BANCO DO BRASIL S/A	1.072.711.367,85	152.573,98	1.072.863.941,61	25,94%	285.981.972,87	0,00	265.981.972,87	14,38%	1.338.845.914,48	22,37%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	805.823.574,90	283,34	605.823.858,24	14,85%	795.767.250,38	205,28	795.767.455,64	43,05%	1.401.591.313,88	23,42%
BANCO BRADESCO S/A	489.808.195,57	0,00	489.806.195,57	11,84%	95.731.980,58	0,00	95.731.980,56	5,18%	585.538.176,13	9,78%
ITAU UNIBANCO S/A	381.062.537,47	924,99	381.063.462,46	9,21%	143.829.341,99	719,03	143.830.061,02	7,78%	524.893.523,48	8,77%
BANCO BTG PACTUAL	1.168.872.922,57	0,00	1.166.872.922,57	28,21%	407.585.714,95	0,00	407.585.714,95	22,05%	1.574.458.637,52	26,31%
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	58.300.887,93	0,00	58.300.887,93	1,41%	32.188.159,94	0,00	32.188.159,94	1,74%	90.489.047,87	1,51%
BANCO SANTANDER S/A	199.702.543,20	0,00	199.702.543,20	4,83%	44.106.357,78	0,00	44.106.357,76	2,39%	243.808.900,96	4,07%
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA.	21.958.911,97	0,00	21.958.911,97	0,53%	12.414.170,50	0,00	12.414.170,50	0,87%	34.373.082,47	0,57%
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA.	9.748.804,88	0,00	9.748.804,88	0,24%	17.504.685,62	0,00	17.504.685,62	0,95%	27.253.490,50	0,46%
BANCO SAFRA S/A	65.055.812,47	0,00	65.055.812,47	1,57%	22.287.085,40	0,00	22.287.085,40	1,21%	87.342.897,87	1,46%
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA.	8.303.439,94	0,00	8.303.439,94	0,20%			0,00	0,00%	8.303.439,94	0,14%
BRZ INVESTIMENTOS LTDA.	0,00	0,00	0,00	0,00%			0,00	0,00%	0,00	0,00%
TPE GESTORA DE RECURSOS LTDA.	36.435.726,13	0,00	36.435.726,13	0,88%	11.129.556,92	0,00	11.129.556,92	0,80%	47.565.283,05	0,79%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA.	19.865.274,50	0,00	19.865.274,50	0,48%			0,00	0,00%	19.865.274,50	0,33%
TOTAIS	4.135.647.999,18	153.782,29	4.135.801.781,47	100,00%	1.848.526.276,87	924,31	1.848.527.201,18	100,00%	5.984.328.982,65	100,00%

PLANO FINANCEIRO - DEMONSTRATIVO DE ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS DA CARTEIRA										
ADRAMENTO LEGAL DA CARTEIRA DA AMPREV - LIMITES DA RESOLUÇÃO 4.963/2021-CMN com Vinculação à Nota Técnica SEI Nº 12/2017-CGACI/SRPPS/SPREV/MF E POLITICA DE INVESTIME										
POSIÇÕES DA CARTEIRA				ENQUADRAMENTO E LIMITES LEGAIS - ELEVAÇÕES PERMITIDAS CONFORME CERTIFICAÇÃO PRO-GESTÃO NÍVEL II						
PRODUTO DE INVESTIMENTO	Estratégia do Produto	Recurso Aplicado Saldo - R\$	Participação da Aplicação na Carteira PF - %	Patrimônio Líquido (PL) do Fundo - R\$	Participação da Aplicação no PL do Fundo - %	Total do Segmento em R\$	Enquadramento na Resolução 4.963/2021-CMN	% do Item da Res. 4.963 no PL Amprev - PF	Limite Max. Permitido Res. 4.963/2021-CMN	Limite Max. Polit. Invest. da AMPREV
Carteira Administrada de TPF Banco do Brasil	TPF - "M.MERC."	781.084.248,92	18,89%							
Carteira Administrada de TPF BTG Pactual	TPF - "M.MERC."	243.287.826,57	5,88%							
Carteira Administrada de TPF Caixa Econômica - PF	TPF - "M.MERC."	326.070.512,55	7,88%			2.071.462.684,46	Art. 7º, Inciso I, alínea "a"	50,09%	100,00%	100,00%
Carteira Administrada BTG Pactual TPF "Marc. Curva" - PF	TPF - "M.CURVA"	721.020.096,42	17,43%							
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	IMA-B	105.234.096,55	2,54%	817.539.930,04	12,87%	105.234.096,55	Art. 7º, Inc. I, alín. "b"	2,54%	100,00%	100,00%
FIC FI Caixa Novo Brasil Renda Fixa Referenciado IMA-B LP	IMA-B	125.773.193,03	3,04%	2.105.457.404,21	5,97%					
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	IMA-B	164.963.005,47	3,99%	1.290.479.677,53	12,78%					
FI Caixa Brasil RF Referenciado DI Longo Prazo	CDI	153.979.869,32	3,72%	12.954.528.143,84	1,19%					
BB Previdenciário Fluxo Renda Fixa Simples FIC FI	CDI	1.472.537,84	0,04%	3.157.315.937,43	0,05%					
Itaú Institucional Alocação Dinâmica Renda Fixa FIC FI	ALOCAÇÃO	51.599.505,39	1,25%	2.528.329.321,31	2,04%					
Itaú Soberano Renda Fixa Simples LP FICFI	CDI	163.002.596,93	3,94%	27.656.938.250,87	0,56%	1.444.582.911,24	Art. 7º, Inciso III, alínea "a"	34,93%	70,00%	70,00%
BTG Pactual Tesouro Selic FI RF Referenciado DI	CDI	166.809.707,30	4,03%	9.483.334.112,47	1,76%					
Bradesco FI RF Referenciado DI Federal Extra	CDI	241.345.286,61	5,84%	7.176.589.326,21	3,36%					
Santander RF Referenciado DI Institucional Premium FIC FI	CDI	44.327.525,55	1,07%	2.186.258.657,96	2,03%					
Safira Soberano Regime Próprio FIC de FI RF Referenciado DI	CDI	65.056.812,47	1,57%	3.750.698.852,34	1,73%					
BB Previdenciário Renda Fixa Referenciado DI LP Perfil FIC FI	CDI	266.253.871,33	6,44%	10.247.937.610,00	2,60%					
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	CREDITO PRIVADO	19.799.819,90	0,48%	630.378.446,40	3,14%	19.799.819,90	Art. 7º, Inciso V, alínea "b"	0,48%	10,00%	10,00%
Bradesco - Letra Financeira - Prazo 05 Anos - LF0022009M7	AT.FIN. RF - LF	31.782.953,98	0,77%							
BTG Pactual - Letra Financeira - Prazo 05 Anos - LF0022009R0	AT.FIN. RF - LF	31.814.300,87	0,77%			214.313.386,35	Art. 7º, Inciso IV	5,18%	20,00%	20,00%
Itaú Unibanco - Letra Financeira - Prazo 02 Anos - LF PRE	AT.FIN. RF - LF	100.575.210,40	2,43%							
Santander - Letra Financeira - Prazo 02 Anos - LF IPCA	AT.FIN. RF - LF	50.140.921,10	1,21%							
Bradesco FI em Ações Dividendos	IDIV	48.846.647,39	1,18%	674.542.913,01	7,24%					
AZ Quest Small Mid Caps FIC de FIA	SMML MID	58.300.887,93	1,41%	1.062.628.935,91	5,49%					
Itaú Vanguarda Dividendos Fundo de Investimento em Ações	IDIV	21.958.911,97	0,53%	913.956.760,51	2,40%					
BB Ações Valor FIC de FI em Ações	AÇÕES VALOR	4.100.889,66	0,10%	1.028.283.715,44	0,40%	179.391.867,96	Art. 8º, Inciso I	4,34%	40,00%	40,00%
Vinci Mosaico Fundo de Investimento de Ações	AÇÕES LIVRE	9.748.804,88	0,24%	834.960.605,48	1,17%					
Tarpon GT 30 FIC De FIA	AÇÕES LIVRE	36.435.726,13	0,88%	477.030.563,23	7,64%					
Santander Global Equities Dólar Master MM Inv. no Exterior FI	MSCI WORLD	0,00	0,00%	0,00	0,00%					
Itaú Ações Europa Investimento no Exterior FIC de FI	I.E. - LIVRE	0,00	0,00%	0,00	0,00%					
Itaú World Equities FIC de FI em Ações Investim. no Exterior	MSCI WORLD	0,00	0,00%	0,00	0,00%					
BB Multimercado Global Select Equity Investim. no Exterior FI	MSCI WORLD	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	Art. 9º, Inciso II	0,00%	10,00%	10,00%
BB Multimercado Schroder Investimento no Exterior FI	I.E. - LIVRE	0,00	0,00%	0,00	0,00%					
BB Ações Nordea Global Climate And Environment I.E. FI	MSCI WORLD	0,00	0,00%	0,00	0,00%					
BB Ações Globais Hedge Investimento no Exterior FI	MSCI WORLD	0,00	0,00%	0,00	0,00%					
Fundo de Investimento em Ações Caixa Institucional BDR Nível I	BDRX	0,00	0,00%	0,00	0,00%					
Safira Consumo Americano FI em Ações BDR-Nível I PB	BDRX	0,00	0,00%	0,00	0,00%	2.868.302,12	Art. 9º, Inciso III	0,07%	10,00%	10,00%
BB Ações ESG Fundo de Investimento em Ações - BDR Nível I	BDRX	0,00	0,00%	0,00	0,00%					
Bradesco Institucional FI Ações BDR Nível I	BDRX	2.868.302,12	0,07%	133.628.236,75	2,15%					
Rio Bravo Proteção II Fundo de Investimento Multimercado	MULTMERC	19.865.274,50	0,48%	155.972.117,32	12,74%	19.865.274,50	Art. 10º, Inciso I	0,48%	10,00%	10,00%
Pátria Special Opportunities I - FIQ FIP	FIP	29.647,81	0,00%	2.434.246,86	1,22%					
Pátria Brasil Infraestrutura III FIQ FIP	FIP	8.273.792,13	0,20%	416.839.473,86	1,98%					
FIC FIP Kinea Private Equity II	FIP	2.084.825,42	0,05%	165.456.230,70	1,26%					
Terras Brasil - FIP	FIP	0,00	0,00%	0,00	0,00%	78.129.656,10	Art. 10º, Inciso II	1,89%	5,00%	5,00%
BTG Pactual Timberland Fund I - FIQ de FIP	FIP	3.940.991,41	0,10%	96.013.870,44	4,10%					
Kinea Private Equity IV Feeder Institucional I FIP Multiestrategia	FIP	63.800.399,33	1,54%	1.752.264.903,11	3,64%					
TOTAL SALDOS CONTAS COR. + VALORES EM TRANS.	DISPONIB CC + VT	153.782,29	0,00%			153.782,29	Disponib. C/C + V.L.	0,00%	0,00%	0,00%
TOTAIS DO PLANO FINANCEIRO		4.135.801.781,47	100,00%			4.135.801.781,47		100,00%		

PLANO PREVIDENCIÁRIO - DEMONSTRATIVO DE ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS DA CARTEIRA

ENQUADRAMENTO LEGAL DA CARTEIRA DA AMPREV - LIMITES DA RESOLUÇÃO 4.963/2021-CMN com Vinculação à Nota Técnica SEI Nº 12/2017-CGACI/SRPPS/SPREV/MF E POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

POSIÇÕES DA CARTEIRA				ENQUADRAMENTOS E LIMITES LEGAIS - ELEVAÇÕES PERMITIDAS CONFORME CERTIFICAÇÃO PRO-GESTÃO NÍVEL II						
PRODUTO DE INVESTIMENTO	Estratégia do Produto	Recurso Aplicado Saldo - R\$	Participação da Aplicação na Carteira PF - %	Patrimônio Líquido (PL) do Fundo - R\$	Participação da Aplicação na PL do Fundo - %	Total do Segmento em R\$	Enquadramento na Resolução 4.963/2021-CMN	% do Item da Res. 4.963 no PL Amprev - PF	Limite Max. Permitido Res. 4.963/2021-CMN	Limite Max. Polit. Invest. da AMPREV
Carteira Administrada de TPF Caixa Econômica - PP	TPF - "M.MERC."	661.103.621,89	35,76%			960.846.922,36	Art. 7º, Inciso I, alínea "a"	51,98%	100,00%	100,00%
Carteira Administrada BTG Pactual TPF "Marc. Curva" - PP	TPF - "M.CURVA"	299.743.300,47	16,22%							
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	IMA-B	6.755.990,61	0,37%	817.539.930,04	0,83%	6.755.990,61	Art. 7º, Inciso I, alínea "a"	0,37%	100,00%	100,00%
FIC FI Caixa Novo Brasil Renda Fixa Referenciado IMA-B LP	IMA-B	102.713.866,07	5,56%	2.105.457.404,21	4,88%					
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	IMA-B	14.646.857,39	0,79%	1.290.479.677,53	1,13%					
FI Caixa Brasil RF Referenciado DI Longo Prazo	CDI	31.949.782,40	1,73%	12.954.528.143,84	0,25%					
BB Previdenciário Fluxo Renda Fixa Simples FIC FI	CDI	8.553.653,33	0,46%	3.157.315.937,43	0,27%					
Itau Institucional Alocação Dinâmica Renda Fixa FIC FI	ALOCAÇÃO	9.721.890,62	0,53%	2.528.329.321,31	0,38%					
BTG Pactual Tesouro Selic FI RF Referenciado DI	CDI	33.037.036,24	1,79%	9.483.334.112,47	0,35%	632.802.354,43	Art. 7º, Inciso III, alínea "a"	34,22%	70,00%	70,00%
Itaú Soberano Renda Fixa Simples LP FIC FI	CDI	127.490.581,23	6,90%	27.656.938.250,87	0,46%					
BB Previdenciário Renda Fixa Referenciado DI LP Perfil FIC FI	CDI	238.449.400,82	12,90%	10.247.937.610,00	2,33%					
Bradesco FI RF Referenciado Di Federal Extra	CDI	31.471.572,68	1,70%	7.176.589.326,21	0,44%					
Safra Soberano Regime Próprio FIC de FI RF Referenciado DI	CDI	22.287.085,40	1,21%	3.750.698.852,34	0,59%					
Santander RF Referenciado DI Institucional Premium FIC FI	CDI	12.280.648,25	0,66%	2.186.258.657,96	0,56%					
BB Previdenciário Renda Fixa Crédito Privado IPCA III FI	CREDITO PRIVADO	11.948.822,16	0,65%	630.378.445,40	1,90%	11.948.822,16	Art. 7º, Inciso V, alínea "b"	0,65%	10,00%	10,00%
BTG Pactual - Letra Financeira - Prazo 05 Anos - LF0022009QZ	AT.FIN. RF - LF	15.907.150,43	0,86%							
Bradesco - Letra Financeira - Prazo 05 Anos - LF0022009M4	AT.FIN. RF - LF	15.891.476,99	0,86%							
BTG Pactual - Letra Financeira - Prazo 05 Anos - LF002200B7Z	AT.FIN. RF - LF	22.980.702,65	1,24%			105.017.554,11	Art. 7º, Inciso IV	5,68%	20,00%	20,00%
Bradesco - Letra Financeira - Prazo 05 Anos - LF002200JED	AT.FIN. RF - LF	25.168.505,14	1,36%							
Santander - Letra Financeira - Prazo 02 Anos - LF IPCA - PP	AT.FIN. RF - LF	25.069.718,90	1,36%							
BTG Pactual Infra-B Fundo Incentivado de Investim. Infraest. RF	DEBENT. INFRAEST.	378.283,15	0,02%	7.565.662,96	5,00%	378.283,15	Art. 7º, Inciso V, alínea "c"	0,02%	10,00%	10,00%
Bradesco FI em Ações Dividendos	IDIV	8.553.568,36	0,46%	674.542.913,01	1,27%					
AZ Quest Small Mid Caps FIC de FIA	SMLL MID	32.188.159,94	1,74%	1.062.628.935,91	3,03%					
Icatu Vanguarda Dividendos Fundo de Investimento em Ações	IDIV	12.414.170,50	0,67%	913.956.760,51	1,36%					
BB Ações Valor FIC de FI em Ações	AÇÕES VALOR	7.030.096,56	0,38%	1.028.283.715,44	0,68%	88.820.237,90	Art. 8º, Inciso I	4,80%	40,00%	40,00%
Vinci Mosaico Fundo de Investimento de Ações	AÇÕES LIVRE	17.504.685,62	0,95%	834.980.605,48	2,10%					
Tarpon GT 30 FIC De FIA	AÇÕES LIVRE	11.129.556,92	0,60%	477.030.563,23	2,33%					
Santander Global Equities Dólar Master MM Inv. no Exterior FI	MSCI WORLD	0,00	0,00%	0,00	0,00%					
BB Multimercado Global Select Equity Investim. no Exterior FI	MSCI WORLD	0,00	0,00%	0,00	0,00%					
BB Multimercado Schroder Investimento no Exterior FI	I.E. - LIVRE	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	Art. 9º, Inciso II	0,00%	10,00%	10,00%
Itaú World Equities FIC de FI em Ações Investim. no Exterior	MSCI WORLD	0,00	0,00%	0,00	0,00%					
BB Ações Nordea Global Climate And Environment I.E. FI	MSCI WORLD	0,00	0,00%	0,00	0,00%					
Itaú Ações Europa Investimento no Exterior FIC de FI	I.E. - LIVRE	0,00	0,00%	0,00	0,00%					
Fundo de Investimento em Ações Caixa Institucional BDR Nível I	BDRX	0,00	0,00%	0,00	0,00%					
Safra Consumo Americano FI em Ações BDR-Nível I PB	BDRX	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	Art. 9º, Inciso III	0,00%	10,00%	10,00%
BB Ações ESG Fundo de Investimento em Ações - BDR Nível I	BDRX	0,00	0,00%	0,00	0,00%					
BTG Pactual Economia Real FIP Multiestratégia	FIP	35.539.242,01	1,92%	2.556.476.338,04	1,39%	42.156.112,15	Art. 10º, Inciso II	2,28%	5,00%	5,00%
Kinea Private Equity V Feeder Institucional I FIP Multiestratégia	FIP	6.616.870,14	0,36%	203.334.317,25	3,25%					
TOTAL SALDOS CONTAS COR. + VALORES EM TRANS.	DISPONIB CC + VT	924,31	0,00%			924,31	Disponib. C/C + V.T.	0,00%	0,00%	0,00%
TOTAIS DO PLANO PREVIDENCIÁRIO		1.848.527.201,18	100,00%			1.848.527.201,18		100,00%		

DEMONSTRATIVOS DE RENTABILIDADES DA CARTEIRA DA AMPREV - Somente Aplicações

JUNHO DE 2022						
PLANO FINANCEIRO						
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%
CARTEIRAS ADMIN. TIT. PÚB. FEDERAIS - A MERCADO	1.362.024.728,50	1.478.256.584,94	1.478.370.176,18	-2.003.690,48	1.359.907.446,78	-0,147123
CARTEIRAS ADMIN. TIT. PÚB. FEDERAIS - NA CURVA	414.345.868,81	0,00	0,00	3.254.233,02	417.600.101,83	0,785390
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.836.229.781,96	60.224.744,53	50.431.634,86	12.836.556,38	1.858.859.448,01	0,695363
ATIVOS FINANCEIRO DE R.F. EMITIDOS POR INST. FINANC.	62.336.217,55	0,00	0,00	597.241,32	62.933.458,87	0,958097
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	203.068.308,76	0,00	13.071.981,07	-19.527.747,16	170.468.580,53	-10,277960
FUNDOS DE INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	95.435.184,96	2.879.447,00	0,00	800.612,16	99.115.244,12	0,814337
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	133.653.825,18	0,00	0,00	-1.667.544,78	131.986.280,40	-1,247660
TOTAIS - PLANO FINANCEIRO	4.107.093.915,72	1.541.360.776,47	1.541.873.792,11	-5.710.339,54	4.100.870.560,54	-0,139053
PLANO PREVIDENCIÁRIO						
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%
CARTEIRAS ADMIN. TIT. PÚB. FEDERAIS - A MERCADO	658.222.573,33	1.185.318.846,26	1.185.376.457,56	2.601.495,51	660.766.457,54	0,395265
CARTEIRAS ADMIN. TIT. PÚB. FEDERAIS - NA CURVA						
FUNDOS DE RENDA FIXA	850.995.480,85	158.456.925,49	111.763.079,38	6.669.035,52	904.358.342,48	0,742911
ATIVOS FINANCEIRO DE R.F. EMITIDOS POR INST. FINANC.	53.712.574,53	0,00	0,00	445.928,03	54.158.502,56	0,830212
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	104.006.170,50	0,00	9.042.391,11	-10.189.020,39	84.774.759,00	-10,729375
FUNDOS DE INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	30.618.096,22	5.647.751,17	0,00	-280.691,79	35.985.155,60	-0,773984
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	55.919.580,27	0,00	0,00	-426.315,20	55.493.265,07	-0,762372
TOTAIS - PLANO PREVIDENC.	1.753.474.455,70	1.349.423.522,92	1.306.181.928,05	-1.179.568,32	1.795.536.482,25	-0,065651
CARTEIRA TOTAL - PF + PP	5.860.568.371,42	2.890.784.299,39	2.848.055.720,16	-6.889.907,86	5.896.407.042,79	-0,116713

Rentabilidade da carteira e Meta de rentabilidade em maio de 2022:

Da Política Anual Investimentos, exercício 2022, da AMPREV, extraímos o seguinte, vejamos:

conforme resultado da Avaliação Atuarial de 2021 do RPPS do Estado do Amapá, elaborado pela Agenda Assessoria, o qual apresentou déficit atuarial, a fim de mitigar a possibilidade do aumento

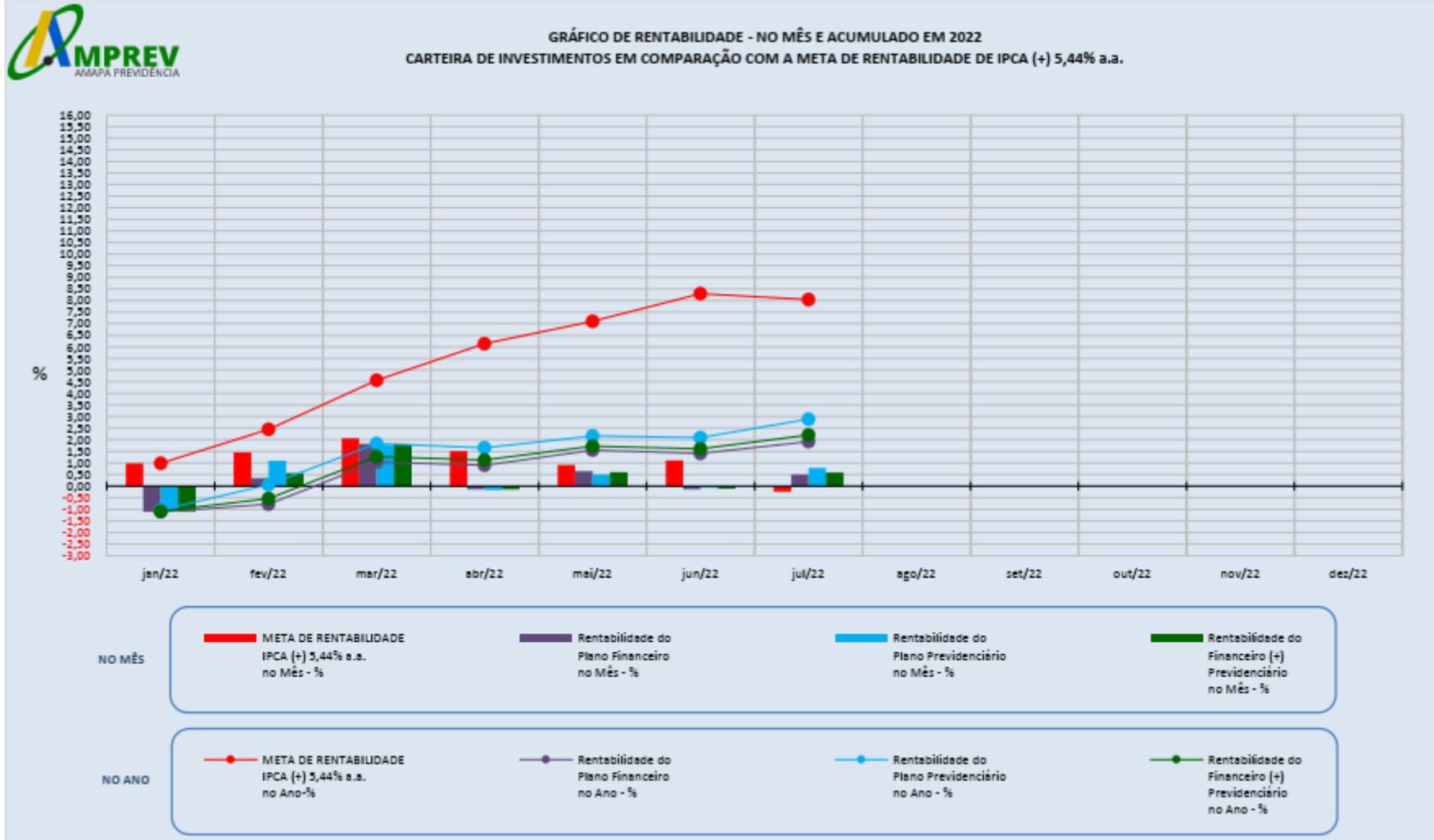


desse déficit e por aderência à duração do passivo atuarial, o juro real da **meta de rentabilidade prevista para o exercício de 2022 será o mesmo de 2021, de 5,44% a.a.. (G. N.)**

Vejamos as informações do mês de **julho** sobre rentabilidade que constam no demonstrativo:

DEMONSTRATIVOS DE RENTABILIDADES DA CARTEIRA DA AMPREV - Somente Aplicações

RENTABILIDADE ACUMULADA DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV E DA META DE RENTABILIDADE EM 2022 - (%)								
MÊS	META DE RENTABILIDADE		PLANO FINANCEIRO		PLANO PREVIDENCIÁRIO		CONSOLIDAÇÃO PF + PP	
	META DE RENTABILIDADE IPCA (+) 5,44% a.a. no Mês - %	META DE RENTABILIDADE IPCA (+) 5,44% a.a. no Ano-%	Rentabilidade do Plano Financeiro no Mês - %	Rentabilidade do Plano Financeiro no Ano - %	Rentabilidade do Plano Previdenciário no Mês - %	Rentabilidade do Plano Previdenciário no Ano - %	Rentabilidade do Financeiro (+) Previdenciário no Mês - %	Rentabilidade do Financeiro (+) Previdenciário no Ano - %
dez/21		15,99953		-0,245591		0,585028		-0,023552
jan/22	0,982437	0,982437	-1,108399	-1,108399	-1,035381	-1,035381	-1,087175	-1,087175
fev/22	1,452470	2,449177	0,337501	-0,774639	1,102518	0,055722	0,560245	-0,533021
mar/22	2,062458	4,562148	1,823711	1,034945	1,774056	1,830767	1,808939	1,266276
abr/22	1,502426	6,133117	-0,136122	0,897414	-0,173152	1,654444	-0,147158	1,117254
mai/22	0,912415	7,101492	0,641882	1,545057	0,497403	2,160077	0,598611	1,722553
jun/22	1,112466	8,292960	-0,139053	1,403855	-0,065651	2,093007	-0,116713	1,603830
jul/22	-0,237595	8,035661	0,504179	1,915112	0,778902	2,888212	0,588882	2,202156
ago/22								
set/22								
out/22								
nov/22								
dez/22								
Acumulado	8,035661		1,915112		2,888212		2,202156	



RENDIMENTO (R\$) EM COMPARAÇÃO COM O VALOR DA META DE RENTABILIDADE - R\$				
PLANO FINANCEIRO				
MÊS	Rendimento do Plano Financeiro - R\$	Meta de Rentabilidade IPCA (+) 5,44% a.a. no Mês - Em R\$	Rendimento do Plano (-) Valor da Meta de Rentabilidade - R\$	Rentabilidade Relativa em Relação a Meta de Rentabilidade - %
jan-22	-43.862.588,65	38.877.925,69	-82.740.514,34	-112,82
fev-22	13.402.033,34	57.677.080,37	-44.275.047,03	23,24
mar-22	72.066.343,73	81.500.740,65	-9.434.396,92	88,42
abr-22	-5.541.974,52	61.188.729,77	-66.710.704,29	-9,06
mai-22	26.194.576,53	37.234.753,66	-11.040.177,13	70,35
jun-22	-5.710.339,54	45.884.311,39	-51.394.650,93	-12,50
jul-22	20.746.471,17	-9.776.812,18	30.523.283,35	-212,20
ago-22				
set-22				
out-22				
nov-22				
dez-22				
ACUMULADO NO ANO	77.294.522,06	312.366.729,35	-235.072.207,29	23,83



RENDIMENTO (R\$) EM COMPARAÇÃO COM O VALOR DA META DE RENTABILIDADE - R\$				
PLANO PREVIDENCIÁRIO				
MÊS	Rendimento do Plano Previdenc. - R\$	Meta de Rentabilidade IPCA (+) 5,44% a.a. no Mês - Em R\$	Rendimento do Plano (-) Valor da Meta de Rentabilidade - R\$	Rentabilidade Relativa em Relação a Meta de Rentabilidade - %
jan-22	-16.789.631,94	15.931.097,91	-32.720.729,85	-105,39
fev-22	17.983.324,15	23.691.430,06	-5.708.105,91	75,91
mar-22	29.688.167,18	34.514.463,93	-4.826.296,75	86,02
abr-22	-2.993.066,91	25.970.597,71	-28.963.664,62	-11,52
mai-22	8.678.666,71	15.919.785,32	-7.241.118,61	54,51
jun-22	-1.179.568,32	19.987.853,04	-21.167.421,36	-5,90
jul-22	14.286.933,37	-4.358.066,27	18.644.999,64	-327,83
ago-22				
set-22				
out-22				
nov-22				
dez-22				
Acumulado	49.674.824,24	131.657.161,71	-81.982.337,47	35,94

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-22	-60.652.220,59	54.809.023,80	-115.461.244,19	-110,66
fev-22	31.385.357,49	81.368.510,43	-49.983.152,94	38,57
mar-22	101.754.510,91	116.015.204,58	-14.260.693,67	87,71
abr-22	-8.535.041,43	87.139.327,48	-95.674.368,91	-9,79
mai-22	34.873.243,24	53.154.538,98	-18.281.295,74	65,81
jun-22	-6.889.907,86	65.672.164,43	-72.562.072,29	-10,49
jul-22	35.033.404,54	-14.134.878,45	49.168.282,99	-247,85
ago-22				
set-22				
out-22				
nov-22				
dez-22				
Acumulado	126.969.346,30	444.023.891,06	-317.054.544,76	27,40



Podemos observar, também, que a evolução dos recursos dos segurados do RPPS do Estado do Amapá (fls. 59), a carteira da AMPREV teve um rendimento líquido acumulado positivo de R\$ 126.969.346,30 (cento e vinte e seis milhões novecentos e sessenta e nove mil trezentos e quarenta e seis reais e trinta centavos).

jan-22	3.974.347.824,59	-43.862.588,65	1.614.801.018,88	-16.789.631,94	5.589.148.643,47	-60.652.220,59	-0,59%	-0,59%	504,38%	
fev-22	3.997.280.427,49	13.402.033,34	1.649.098.600,09	17.983.324,15	5.646.379.027,58	31.385.357,49	1,02%	0,43%	510,57%	
mar-22	4.065.434.572,04	72.066.343,73	1.713.653.626,47	29.688.167,18	5.779.088.198,51	101.754.510,91	2,35%	2,79%	524,92%	
abr-22	4.065.890.509,82	-5.541.974,52	1.725.587.941,09	-2.993.066,91	5.791.478.450,91	-8.535.041,43	0,21%	3,01%	526,26%	
mai-22	4.107.264.443,89	26.194.576,53	1.763.008.486,47	8.678.666,71	5.870.272.930,36	34.873.243,24	1,36%	4,41%	534,78%	
jun-22	4.100.974.189,51	-5.710.339,54	1.795.537.230,72	-1.179.568,32	5.896.511.420,23	-6.889.907,86	0,45%	4,88%	537,62%	
jul-22	4.135.801.781,47	20.746.471,17	1.848.527.201,18	14.286.933,37	5.984.328.982,65	35.033.404,54	1,49%	6,44%	547,11%	
ago-22					0,00	0,00	-100,00%	-100,00%	-100,00%	
set-22					0,00	0,00	#DIV/0!	-100,00%	-100,00%	
out-22					0,00	0,00	#DIV/0!	-100,00%	-100,00%	
nov-22					0,00	0,00	#DIV/0!	-100,00%	-100,00%	
dez-22					0,00	0,00	#DIV/0!	-100,00%	-100,00%	126.969.346,30
	Rendim. Liq. Acum.-2022	77.294.522,06	Rendim. Liq. Acum.-2022	49.674.824,24	Rendim. Liq. Acum.-2022	126.969.346,30				

Conclusão

14. Ao COFISPREV cabe analisar se os procedimentos adotados para garantia dos investimentos estão dentro da legalidade. A gestão de investimentos inclui a adequada estruturação dos riscos inerentes às operações financeiras, uma vez que não existe retorno obtido sem que algum nível de risco seja assumido, e são de responsabilidades do Comitê de Investimentos da AMPREV.

15. Cumpre **recomendar: i)** a inclusão nesses autos da **ATA** que aprovou os referidos demonstrativos, **e ii)** a inclusão nos autos de **relatório detalhado**, no mínimo, trimestralmente, sobre a rentabilidade, os riscos das diversas modalidades de operações realizadas nas aplicações dos recursos do RPPS e a aderência à política anual de investimentos e suas revisões, conforme previsão do art. 3º, inciso V, da Portaria n. 519/2011 (em vigor à época dos fatos), **iii)** os **EXTRATOS FINANCEIROS DAS APLICAÇÕES**.

16. Considerando as informações inseridas na respectiva ATA da 16ª Reunião Ordinária do CIAP/AMPREV, dando conta de resgastes e aplicações sugiro, *ad referendum* do Colegiado, o encaminhamento de convite para que o Coordenador do CIAP, em uma oportuna reunião com esse Conselho nos forneça maiores explicações sobre as razões desses atos.

17. Por todo o exposto, entendo que somente após a apresentação de esclarecimentos sobre a motivação das movimentações de resgaste e aplicação nos investimentos, conforme item 16 supra, teremos elementos hábeis para **conferir conformidade nos atos realizados**, relativo ao Demonstrativo de Consolidação dos Ativos da Carteira de Investimentos dos



Recursos dos Segurados do RPPS e RPPM do Estado do Amapá,
competência **julho de 2022**.

Macapá – AP, 23 de fevereiro de 2023.

Helton Pontes da Costa
Membro Titular do Conselho Fiscal – COFISPREV
Relator Designado

Este relatório foi submetido para apreciação na terceira reunião extraordinária realizada, no dia 23/02/2023, sendo aprovado por unanimidade, pelos demais membros titulares do Conselho Fiscal da Amapá Previdência - COFISPREV, conforme abaixo.

Elionai Dias da Paixão - Conselheiro Titular/Presidente

Arnaldo Santos Filho - Conselheiro Titular

Adriene Ribeiro Benjamin Pinheiro - Conselheira Titular

Francisco das Chagas Ferreira Feijó – Conselheiro Titular



Cód. verificador: 142251430. Cód. CRC: 8A7A864

Documento assinado eletronicamente por **ARNALDO SANTOS FILHO** em 07/03/2023 14:11, **HELTON PONTES** em 07/03/2023 13:22 e outros, conforme decreto nº 0829/2018. A autenticidade do documento pode ser conferida no site: <https://sigdoc.ap.gov.br/autenticador>

