

ANÁLISE TÉCNICA Nº 038/2023–COFISPREV/AMPREV.

PROCESSO: 2022.277.1101990PA.

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

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

CONSELHEIRO RELATOR: Helton Pontes da Costa

Relatório

Trata-se de análise dos **autos do processo nº 2022.277.1101990PA**, cujo objeto versa sobre **Demonstrativo de Consolidação dos Ativos da Carteira de Investimentos da Amapá Previdência, competência outubro de 2022**.

Os autos foram encaminhados para minha relatoria, recebidos em mídia digital, em 1 arquivo em PDF, contendo **61 páginas**. Não consta nesses autos digitais originais: a **ATA**, que deliberou sobre a aprovação do demonstrativo de investimento, o **RELATÓRIO** detalhado com informações sobre rentabilidade, riscos das aplicações e os **EXTRATOS FINANCEIROS DAS APLICAÇÕES**.

Consta às **fls. 3-52** 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 outubro de 2022, em planilhas, com posição final no mês do Plano Financeiro e Plano Previdenciário, em cada produto de investimentos**.

Às fls. **57** 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 MAIORIA, APROVAR os**

demonstrativos de consolidação dos ativos da carteira de investimentos dos recursos dos segurados do RPPS do Estado do Amapá, do mês de outubro de 2022, processo nº 2022.277.1101990PA, conforme 22ª Reunião Ordinária, realizada em 29 de novembro de 2022.

Em **07/03/2023**, esses autos digitais foram encaminhados para minha relatoria.

É o que importa relatar.

Manifestação

Da Competência do Conselho Fiscal da AMPREV

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)

O Comitê de Investimentos da Amapá Previdência, constituído em conformidade com o disposto no art. 103, inc. II, da Lei n. 9015/2005, c/c art. 91 da Portaria n. 1.467, de 2 de junho de 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.

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.

Em 23/03/2023, este Conselheiro Relator realizou consulta no sítio eletrônico da Amapá Previdência (<https://amprev.ap.gov.br/atas>), momento que foi possível constatar a inexistência e disponibilização para download da **ATA DA 22ª REUNIÃO ORDINÁRIA**, do CIAP/AMPREV, que aprovou esse demonstrativo, conforme referenciado na Certidão de Deliberação às **fls. 57** dos autos .

A carteira e suas aplicações

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, e se seguiu os parâmetros e diretrizes estabelecidas pelo Conselho Monetário Nacional, conforme Resolução CMN 4.963/2021.

Nesse sentido, como não consta, ainda, nesses autos digitais a ATA que deliberou sobre a sua aprovação, nem sua disponibilização no sítio eletrônico da Instituição, resta prejudicado fazer uma análise com informações importantes para se compreender a dinâmica da aprovação no âmbito do Comitê de Investimentos da AMPREV.

A par dessas informações, no entender desse relator, é deveras importante prospectar maiores informações junto ao coordenador do CIAP para esclarecimentos da aprovação desse demonstrativo.



Das informações dos demonstrativos:

A carteira da AMPREV, confirmando-se a observância à Resolução 4.963/2021-CMN, com vinculação à Nota Técnica SEI Nº 12/2017-CGACI/SRPPS/SPREV/MF, tem alocação diversificada e distribuída nas seguintes instituições, do qual trago ao conhecimento alguns fragmentos dos demonstrativos do mês, nestes termos:



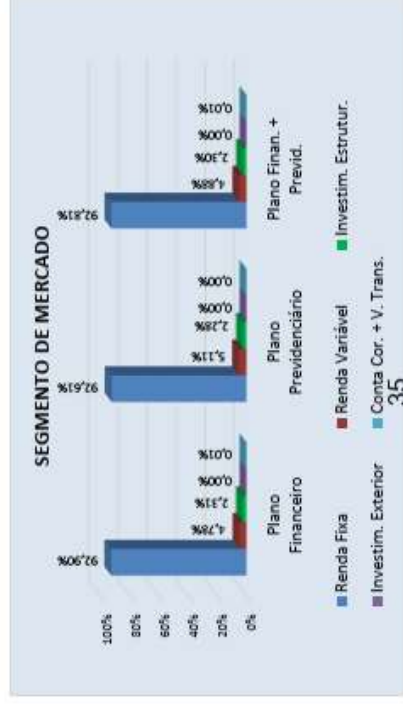
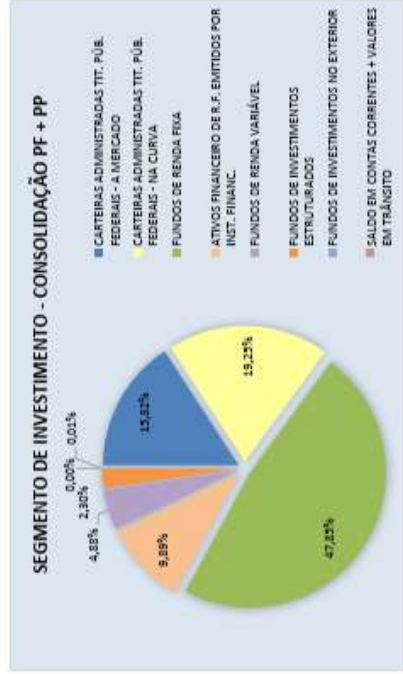
AMAPÁ PREVIDÊNCIA - AMPREV
DIRETORIA FINANCEIRA E ATUARIAL - DIFAT
DIVISÃO DE INVESTIMENTOS E MERCADO - DIM

DEMONSTRATIVO DE CONSOLIDAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA
DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO E ENQUADRAMENTO LEGAL
POSICÃO: OUTUBRO/2022 - EM 31/10/2022

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\$)	Particip. (%)	Rendim. Liq. -R\$	Saldo (R\$)	Particip. (%)	Rendim. Liq. -R\$	Saldo (R\$)	Particip. (%)	Rendim. Liq. -R\$	
CARTERAS ADMINISTRADAS TIT. PUB. FEDERAIS - A VERCAÇÃO	676.313.186,57	13,54%	5.061.750,48	322.347.384,00	66,22%	4.847.959,76	907.050.620,07	15,62%	11.000.716,23							
CARTERAS ADMINISTRADAS TIT. PUB. FEDERAIS - NA CURVA	814.889.033,81	16,57%	5.980.982,15	392.250.353,70	20,09%	2.136.749,80	1.214.170.387,51	19,28%	8.116.754,56							
FUNDOS DE RENDA FIXA	2.154.003.479,19	43,57%	22.746.448,41	663.902.939,95	43,46%	10.485.055,67	3.077.006.418,14	47,65%	38.231.804,14							
ATIVOS FINANCEIRO DE R.F. EMITIDOS POR INST. FINANC.	368.497.256,38	6,52%	1.486.557,70	265.462.839,83	16,65%	300.011,47	653.600.076,11	8,90%	1.736.005,10							
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	206.259.299,29	4,13%	15.171.14,38	101.519.254,22	5,11%	7.402.333,37	307.908.553,57	4,89%	22.574.046,55							
FUNDOS DE INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	99.913.713,63	2,31%	308.696,50	45.379.021,93	2,88%	-183.050,99	145.192.756,76	2,30%	126.635,51							
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		0,00%			0,00%			0,00%								
SUBTOTAL - SOMENTE RECURSOS APLICADOS	4.318.485.699,37		51.656.757,11	1.307.661.723,62		25.788.045,10	8.308.347.691,09		77.444.606,27							
SALDO EM CONTAS CORRENTES + VALORES EM TRÂNSITO	595.943,81	0,01%	1.128,56	1.128,56	0,00%		597.072,37	0,01%								
TOTAIS	4.319.081.643,18	100,00%	51.656.757,11	1.587.842.921,19	100,00%	25.788.045,10	8.308.644.763,37	100,00%	77.444.606,27							



ESTADO DO AMAPÁ



35

Divisão de Investimentos e Mercado - DIM / DIFAT / AMPREV - Elaboração Finalizada em 25/11/2022.



AMAPÁ PREVIDÊNCIA - AMPREV
DIRETORIA FINANCEIRA E ATUARIAL - DIFAT
DIVISÃO DE INVESTIMENTOS E MERCADO - DIM

DEMONSTRATIVO DE CONSOLIDAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA
DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO E ENQUADRAMENTO LEGAL
POSIÇÃO: OUTUBRO/2022 - EM 31/10/2022

INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	PLANO FINANCEIRO - PF			PLANO PREVIDENCIÁRIO - PP			DISPONIBIL. TOTAL - PF + PP		
	Aplicações - R\$	Saldo CIC+VT - R\$	Total Instituiç. - R\$	Aplicações - R\$	Saldo CIC+VT - R\$	Total Instituiç. - R\$	Particip. %	Total Instituiç. - R\$	Particip. %
BANCO DO BRASIL S/A	1.026.152.065,96	112.820,66	1.026.264.886,62	358.325.090,63	0,00	358.325.090,63	16,03%	1.384.589.887,15	21,35%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	293.593.340,80	2.387,40	293.595.728,20	566.442.241,67	409,51	566.442.651,18	28,50%	860.026.379,39	13,04%
BANCO BRADESCO S/A	509.345.971,26	2.478,90	509.348.450,16	98.496.756,11	0,00	98.496.756,11	4,95%	607.845.206,28	8,54%
ITAU UNIBANCO S/A	392.016.467,53	26.696,44	392.043.163,97	147.900.507,97	719,03	147.901.227,00	7,44%	539.944.390,97	8,56%
BANCO BTG PACTUAL	1.647.311.699,35	451.559,92	1.647.763.249,27	664.226.773,55	0,02	664.226.773,57	33,41%	2.311.990.022,84	35,95%
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	65.807.744,38	0,00	65.807.744,38	36.332.726,25	0,00	36.332.726,25	1,83%	102.140.470,63	1,52%
BANCO SANTANDER S/A	205.463.230,70	0,49	205.463.231,19	44.896.093,30	0,00	44.896.093,30	2,26%	250.359.324,49	3,97%
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA.	24.525.269,62	0,00	24.525.269,62	13.865.025,12	0,00	13.865.025,12	0,70%	38.390.293,74	0,51%
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA.	11.262.894,29	0,00	11.262.894,29	20.222.983,75	0,00	20.222.983,75	1,02%	31.485.878,04	0,50%
BANCO SAFRA S/A	67.208.263,34	0,00	67.208.263,34	23.024.480,80	0,00	23.024.480,80	1,16%	80.232.744,14	1,43%
PATRIA INVESTIMENTOS LTDA.	8.734.652,79	0,00	8.734.652,79	0,00	0,00	0,00	0,00%	8.734.652,79	0,14%
TPE GESTORA DE RECURSOS LTDA.	46.255.648,57	0,00	46.255.648,57	14.129.123,48	0,00	14.129.123,48	0,71%	60.384.772,05	0,96%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA.	20.816.660,86	0,00	20.816.660,86	0,00	0,00	0,00	0,00%	20.816.660,86	0,33%
TOTAIS	4.318.465.898,37	595.943,81	4.319.061.842,18	1.987.861.792,63	1.129,56	1.987.862.921,19	100,00%	6.306.944.763,37	100,00%



AMAPÁ PREVIDÊNCIA - AMPREV
DIRETORIA FINANCEIRA E ATUARIAL - DIFAT
DIVISÃO DE INVESTIMENTOS E MERCADO - DIM

DEMONSTRATIVO DE CONSOLIDAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA
DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO E ENQUADRAMENTO LEGAL
POSICÃO: OUTUBRO/2022 - EM 31/10/2022

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 17/2017-CGAC/ISRPPS/SPREV/IMF E POLITICA DE INVESTIMENTE ENQUADRAMENTOS E LIMITES LEGAIS - ELEVAÇÕES PERMITIDAS CONFORME CERTIFICAÇÃO PRO-GESTÃO NÍVEL II										
PRODUTO DE INVESTIMENTO	Estratégia do Produto	Recurso Aplicado	Participação de 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. Polít. Invest. da AMPREV
Carteira Administrada de TPF Banco do Brasil	TPF - "M.MERC."	422.076.069,06	9,77%	1.555.277.659,01	7,02%	1.460.202.170,78	Art. 7º, inciso I, alínea "a"	34,50%	100,00%	100,00%
Carteira Administrada de TPF BTG Pactual	TPF - "M.MERC."	253.237.957,91	5,86%	3.431.043.807,91	1,96%	178.464.128,97	Art. 7º, Inc. I, alin. "a"	4,09%	100,00%	100,00%
Carteira Administrada BTG Pactual - TPF - "M.CURVA"	TPF - "M.CURVA"	814.889.033,81	18,87%	1.550.721.807,59	7,91%					
Santander FIC FI MAB Institucional Titulos Publicos RF LP	IMA-B	105.245.863,63	2,53%							
Scala Sobrante Regime Prosto FIC de FI RF Referenciada DI	COI	67.208.263,34	1,56%							
FIC FI Caixa Novo Brasil Renda Fixa Referenciada IMA-B LP	IMA-B	130.605.268,01	3,02%							
Bancoo Institucional FIC - FI Renda Fixa IMA-B	IMA-B	171.307.418,78	3,97%	1.202.538.082,43	6,25%					
FI Caixa Brasil RF Referenciado DI Longo Prazo	COI	182.578.050,99	3,77%	14.020.474.735,38	1,16%					
BB Previdenciário Fundo Renda Fixa Simples FIC FI	COI	147.041.266,10	3,40%	3.858.205.707,82	3,81%					
Itau Institucional Alocção Dinâmica Renda Fixa FIC FI	ALOCÇÃO	53.173.273,52	1,23%	2.434.045.488,97	2,16%	1.967.286.515,38	Art. 7º, inciso III, alínea "a"	45,32%	70,00%	70,00%
Itau Soberano Renda Fixa Simples LP FIC FI	COI	186.381.330,01	3,90%	29.823.148.034,12	0,56%					
BTG Pactual Tesouro Selic FI RF Referenciado DI	COI	393.461.360,19	9,11%	10.993.075.392,79	3,61%					
Bancoo FI RF Referenciado DI Federal Extra	COI	252.117.156,01	5,84%	8.963.231.945,28	2,81%					
Santander RF Referenciado DI Institucional Premium FIC FI	COI	45.841.303,61	1,06%	2.900.691.599,83	1,64%					
BB Previdenciário Renda Fixa Referenciado DI LP 9e11 FIC FI	COI	432.379.072,34	10,01%	12.427.648.222,70	3,48%					
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado RCA-III	CREDITO PRIVADO	30.253.532,85	0,47%	533.023.575,73	3,73%	20.263.838,88	Art. 7º, Inciso V, alínea "a"	0,47%	10,00%	10,00%
Brasão - Letra Financeira - Prazo 05 Anos - LFO022009M7	AT.FIN. RF - LP	31.898.850,56	0,74%							
BTG Pactual - Letra Financeira - Prazo 05 Anos - LFO022009RO	AT.FIN. RF - LP	31.868.361,08	0,74%							
Itau Unibanco - Letra Financeira - Prazo 02 Anos - LF PRE	AT.FIN. RF - LF	104.022.015,40	2,41%			368.197.235,29	Art. 8º, inciso IV	6,62%	20,00%	20,00%
Santander - Letra Financeira - Prazo 02 Anos - LF IPCA	AT.FIN. RF - LF	50.376.063,46	1,17%							
BTG Pactual - Letra Financeira - Prazo 05 Anos - LFO02200P19	AT.FIN. RF - LF	150.035.510,76	3,47%							
Brasão FI em Ações Dividendos	IDIV	54.026.115,93	1,25%	575.781.909,42	7,99%					
AZ Quest Small Mid Caps FIC de FIA	SMALL MID	85.807.744,38	1,92%	1.146.083.351,86	5,74%					
Itau Vanguardia Dividendos Fundo de Investimento em Ações	IDIV	24.525.268,62	0,57%	957.805.640,45	2,56%					
BB Ações Valor FIC de Fiem Ações	AÇÕES VALOR	4.391.527,50	0,10%	1.073.908.070,60	0,41%	208.288.289,29	Art. 8º, inciso I	4,78%	40,00%	40,00%
Vind Messico Fundo de Investimento de Ações	AÇÕES LIVRE	11.262.694,29	0,26%	966.527.510,12	1,17%					
Taroon GT 30 FIC De FIA	AÇÕES LIVRE	46.255.548,57	1,07%	564.363.593,27	5,98%					
BB Cervo Proteção II Fundo de Investimento Multimercado	MULTIMERC	20.816.863,85	0,48%	153.443.488,63	0,21%	20.818.880,88	Art. 10º, inciso I	0,49%	10,00%	10,00%
Fניה Especial Opportunities I - FIC FI	FIP	30.306,10	0,00%	2.496.576,29	1,22%					
Fניה Brasil Infraestrutura III FIC FIP	FIP	6.704.246,61	0,20%	435.023.715,95	1,96%					
FIC FIP Kinea Private Equity II	FIP	0,00	0,00%	0,00	0,00%	78.888.852,87	Art. 10º, inciso II	1,83%	5,00%	5,00%
BTG Pactual Timberland Fund I - FIC de FIP	FIP	3.820.355,58	0,09%	93.061.863,12	4,11%					
Kinea Private Equity IV Feeder Institucional I FIP Multiestrategia	FIP	54.326.244,28	1,49%	1.776.234.979,05	3,62%					
FIP Multiestrategia Kinea Private Equity II	FIP	2.115.600,32	0,05%	170.201.832,22	1,24%					
TOTAL SALDOS CONTAS COR. + VALORES EM TRANS.	DISPONE CC + VT	495.943,81	0,01%	495.943,81	0,01%	495.943,81	Dispositib. C/C + V.T.	0,01%	0,00%	0,00%
TOTAL DO PLANO FINANCEIRO		4.319.081.842,18	100,00%			4.319.081.842,18		100,00%		

Desenquadramento passivo do inciso II do Art. 27 da Resolução 4.963/2021-CMN, não provocado pela gestão da AMPREV. Não é considerado impiedada, por em prazo de 180 dias para ser reequilibrado.



AMAPÁ PREVIDÊNCIA - AMPREV
DIRETORIA FINANCEIRA E ATUARIAL - DIFAT
DIVISÃO DE INVESTIMENTOS E MERCADO - DIM

DEMONSTRATIVO DE CONSOLIDAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA
DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO E ENQUADRAMENTO LEGAL
POSIÇÃO: OUTUBRO/2022 - EM 31/10/2022

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-CGACISRPPS/SPREV/IMF E POLÍTICA DE INVESTIMENTOS ENQUADRAMENTOS E LIMITES LEGAIS - ELEVAÇÕES PERMITIDAS COM FORME 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 Caixa Econômica - PP	TPF - "MERCADO"	322.347.354,00	10,23%			721.037.737,70	Art. 7º, inciso I, alínea "a"	36,30%	100,00%	100,00%
Carteira Administrada BTG Pactual TPF "Mirc. Curva" - PP	TPF - "MERCADO"	399.290.353,70	20,08%			30.038.028,38	Art. 7º, inciso V, alínea "a"	1,21%	100,00%	100,00%
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RP LP	IMA-B	7.013.544,59	0,35%	1.550.277.699,01	0,45%					
Santander Regime Progiro FIC de FI RF Referenciado DI	COI	23.024.480,80	1,16%	3.431.042.897,91	0,67%					
FIC FI Caixa Novo Brasil Renda Fixa Referenciado IMA-B LP	IMA-B	106.600.643,54	5,37%	1.650.732.847,59	0,46%					
BraDESCO Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	IMA-B	15.210.169,87	0,77%	1.202.538.082,43	1,25%					
FI Caixa Brasil nr Referenciado DI Longo Prazo	COI	137.434.514,13	6,91%	14.020.474.735,30	0,30%					
BB Previdenciário Renda Fixa Simples FIC FI	COI	92.143.262,05	4,64%	3.859.205.707,52	2,39%					
Itaú Institucional Alocação Dinâmica Renda Fixa MFC FI	ALOCACÃO	10.018.408,12	0,50%	2.434.245.480,97	0,41%					
BTG Pactual Tesouro Selic FI RF Referenciado DI	COI	40.374.559,46	2,03%	10.893.075.982,79	0,37%	821.254.088,50	Art. 7º, inciso III, alínea "a"	41,31%	70,00%	70,00%
Itaú soberano Renda Fixa Simples LP FICFI	COI	127.793.146,91	6,43%	29,023.149.034,12	0,43%					
BB Previdenciário Renda Fixa Referenciado DI LP Perfil FIC FI	COI	246.404.123,69	12,40%	12,427.649.222,70	1,98%					
BraDESCO FI RF Referenciado DI Institucional Caixa	COI	32.493.533,24	1,63%	0,903.231.945,20	0,30%					
Santander SF Referenciado DI Institucional Premium FIC FI	COI	12.700.030,47	0,64%	2,800.691.599,83	0,45%					
BB Previdenciário Renda Fixa Crédito Privado IPCA III FI	CREDITO PRIVADO	12.228.547,75	0,62%	530.020.375,70	2,23%	12.228.547,75	Art. 7º, inciso V, alínea "a"	0,02%	10,00%	10,00%
BTG Pactual - Letra Financeira - Prazo 05 Anos - LP02200902	AT.FIN. RF - LF	15.934.280,54	0,80%							
BraDESCO - Letra Financeira - Prazo 04 Anos - LP02200904	AT.FIN. RF - LF	16.947.646,20	0,87%							
BTG Pactual - Letra Financeira - Prazo 05 Anos - LP0220087Z	AT.FIN. RF - LF	22.918.225,75	1,15%			255.402.839,83	Art. 7º, inciso IV	12,85%	20,00%	20,00%
BraDESCO - Letra Financeira - Prazo 05 Anos - LP0220080C	AT.FIN. RF - LF	20.304.664,24	1,00%							
Santander - Letra Financeira - Prazo 02 Anos - LPICPA - PP	AT.FIN. RF - LF	25.182.510,24	1,27%							
BraDESCO - Letra Financeira - Prazo 05 Anos - LP0220080Z	AT.FIN. RF - LF	190.039.419,70	7,55%							
BTG Pactual Infra-8 Fundo Incentivado de Investim. Infraest. RF	DEBENT. INFRAEST.	381.977,31	0,02%	7.639.546,61	5,00%	381.977,31	Art. 7º, inciso V, alínea "a"	0,02%	10,00%	10,00%
BraDESCO FI em Ações Dividendas	IDIV	9.400.349,48	0,48%	0,75.767.939,42	1,40%					
AZ Quest Small Mid Caps FIC de FIA	SMALL MID	36.332.726,25	1,83%	1,146.088.381,86	3,17%					
Itaú Vanguarda Dividenda Fundo de Investimento em Ações	IDIV	13.003.025,12	0,70%	937.003.040,45	1,45%					
BB Ações Valor FIC de FI em Ações	AÇÕES VALOR	7.528.547,14	0,38%	1,073.500.070,60	0,70%	101.539.254,22	Art. 8º, inciso I	5,11%	40,00%	40,00%
Vinci Investimentos Fundo de Investimento em Ações	AÇÕES LIVRE	20.222.903,73	1,02%	900.227.910,12	2,09%					
Tampol GT 30 FIC DE FIA	AÇÕES LIVRE	14.129.123,48	0,71%	664.363.582,27	2,13%					
BTG Pactual Economia Real (FIP) Multiestratégia	FIP	35.292.665,99	1,76%	2,530.690.063,90	1,88%	45.379.021,83	Art. 10º, inciso II	2,28%	5,00%	5,00%
Alinea Private Equity V Festej Institutional I FIP Multiestratégia	FIP	10.086.555,94	0,51%	3,37.313.394,14	2,99%					
TOTAL SALDOS CONTAS COR. + VALORES EM TRANS.	DISPONÍB. CC + VT	1.128,50	0,00%			1.128,50	Disponib. CC + VT.	0,00%	0,00%	0,00%
TOTAL DO PLANO PREVIDENCIÁRIO		1.987.862.921,19	100,00%			1.987.862.921,19		100,00%		

Desenquadramento passivo do inciso II do Art. 27 da Resolução 4.963/2021-CMN, não provocado pela gestão da AMPREV. Não é considerado infrigêndia, porém tem prazo de 180 dias para se reequilibrar.



ESTADO DO AMAPÁ



AMAPÁ PREVIDÊNCIA - AMPREV
DIRETORIA FINANCEIRA E ATUARIAL - DIFAT
DIVISÃO DE INVESTIMENTOS E MERCADO - DIM

DEMONSTRATIVO DE CONSOLIDAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA
DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO E ENQUADRAMENTO LEGAL
POSICÃO: OUTUBRO/2022 - EM 31/10/2022

ATIVO	LIMITES RESOL. CENIR 4.983/2021		ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - RI 2022				DEMONSTRATIVO DA ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA (PF + PP)			SALDO DISPONÍVEL DA ESTRAT. ALVO %
	Artigo	Limite Permitido Pela Resolução (%)	Limite Inferior (%)	Estimativa Alvo (%)	Limite Superior (%)	Posições do Plano Financeiro por Ativos - R\$	Posições do Plano Previdenciário por Ativos - R\$	Posições Consolidadas PF + PP por Ativos - R\$	Posições Consolidadas FF + PP por Ativos - %	
Títulos Públicos Emitidos no TN (CELIC)	Art. 7º, I, e		0,00%	42,00%	100,00%	1.450.202.170,78	721.637.720,70	2.211.332.948,48	35,07%	6,93%
FIPF 100% Títulos Públicos TN	Art. 7º, I, b	100%	0,00%	0,00%	100,00%	178.484.128,97	30.639.065,93	208.492.792,98	3,27%	1,73%
Fiem Índice de Mercado de R\$ (EPI) 120% TP TN	Art. 7º, I, c		0,00%	0,00%	0,00%					0,00%
Fifoneo Fia	Art. 7º, III, a	60%	0,00%	0,00%	60,00%	1.937.285.515,36	821.454.088,90	2.778.539.603,26	41,06%	-34,06%
Fiem Índice de Mercado RF (EPI)	Art. 7º, III, b	60%	0,00%	0,00%	60,00%					0,00%
Fifoneo Precatórios de RF - Emi. Por Inst. Finan.	Art. 7º, IV	20%	0,00%	2,00%	20,00%	368.187.235,28	255.402.528,03	623.800.015,11	9,88%	-7,88%
Fiem Direitos Creditórios - Com Jherir	Art. 7º, V, a	5%	0,00%	0,00%	5,00%					0,00%
Fifoneo Fia Crédito Fidejuss	Art. 7º, V, b	5%	0,00%	0,00%	5,00%	20.263.535,86	12.428.547,75	32.482.684,61	0,52%	0,48%
Fifoneo Fia de Infraestrutura	Art. 7º, V, c	5%	0,00%	0,00%	5,00%		381.977,37	381.977,37	0,01%	0,19%
TOTAL REQUERIMENTO DE RESERVA FEA			0,00%	0,00%	0,00%	4.072.402.895,25	1.803.945.516,48	5.853.348.411,72	92,61%	-11,15%
Fiem Ação	Art. 8º, I	20%	0,00%	17,00%	30,00%	205.263.293,29	101.539.254,22	307.309.553,51	4,83%	12,15%
TOTAL REQUERIMENTO DE RESERVA VARIAVEL			17,00%	17,00%	17,00%	205.263.293,29	101.539.254,22	307.309.553,51	4,83%	12,15%
Fie FC Fidejuss Titulos Fia - Outros Externos	Art. 9º, I	10%	0,00%	0,00%	0,00%					0,00%
Fifoneo de Outros Investimentos no Exterior	Art. 9º, II	10%	0,00%	0,00%	10,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Fifoneo de Outros Ativos - Sem Jherir	Art. 9º, III	10%	0,00%	0,00%	10,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
TOTAL REQUERIMENTO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			0,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Fie FC Fidejuss Titulos Fia - Outros Externos	Art. 10, I	10%	0,00%	0,00%	10,00%	20.676.660,86		20.676.660,86	0,33%	2,67%
Fiem Fundações (Ficome)	Art. 10, II	5%	0,00%	0,00%	5,00%	78.698.582,97	45.279.021,93	124.375.674,90	1,97%	1,93%
Fifoneo - Mercado de Ações	Art. 10, III	5%	0,00%	0,00%	0,00%					0,00%
TOTAL REQUERIMENTO DE INVESTIMENTOS EM RENDIMENTOS			0,00%	0,00%	0,00%	99.613.713,83	45.279.021,93	145.192.715,76	2,34%	3,70%
Fifoneo Fia	Art. 11	5%	0,00%	0,00%	5,00%					0,00%
TOTAL REQUERIMENTO DE FUNDOS IMOBILIÁRIOS			0,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%
Empresas Controladas	Art. 12, I	5%	0,00%	0,00%	0,00%					0,00%
TOTAL REQUERIMENTO DE EMPRESAS CONTROLADAS			0,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Contas Correntes + Poupança + Outros em Titulação)						555.943,81	1.128,58	537.072,37	0,01%	0,00%
TOTAIS - R\$						4.313.081.842,18	1.307.682.321,15	6.384.544.763,37	100,00%	100,00%

OUTUBRO DE 2022										
PLANO FINANCEIRO										
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%				
CARTEIRAS ADMIN. TIT. PUB. FEDERAIS - A MERCADO	900.142.761,41	354.267.586,70	585.058.990,59	5.961.759,45	675.313.136,97	0,890677				
CARTEIRAS ADMIN. TIT. PUB. FEDERAIS - NA CURVA	808.908.051,66	0,00	0,00	5.860.962,15	814.889.033,81	0,739390				
FUNDOS DE RENDA FIXA	2.036.182.364,88	318.847.203,36	223.772.637,52	22.746.446,47	2.154.003.479,19	1,067279				
ATIVOS FINANCEIRO DE R.F. EMITIDOS POR INST. FINANC.	216.710.277,56	150.000.000,00	0,00	1.486.957,72	368.197.235,28	0,405486				
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	191.097.586,41	0,00	0,00	15.171.712,88	206.269.299,29	7,939249				
FUNDOS DE INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	99.979.669,79	2.114.605,56	2.589.458,02	308.896,50	99.813.713,83	0,310434				
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR						0,000000				
TOTAIS - PLANO FINANCEIRO	4.253.020.731,71	825.229.395,62	811.420.396,13	51.656.757,17	4.318.485.896,37	1,210659				
PLANO PREVIDENCIÁRIO										
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%				
CARTEIRAS ADMIN. TIT. PUB. FEDERAIS - A MERCADO	316.725.159,47	972.871.920,51	972.897.654,76	5.647.959,78	322.347.384,00	1,763382				
CARTEIRAS ADMIN. TIT. PUB. FEDERAIS - NA CURVA	300.128.694,58	97.025.909,32	0,00	2.135.749,90	399.290.353,70	0,537763				
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.062.462.526,55	39.313.934,67	248.358.679,94	10.485.055,67	863.902.938,95	1,228596				
ATIVOS FINANCEIRO DE R.F. EMITIDOS POR INST. FINANC.	105.102.828,36	150.000.000,00	0,00	300.011,47	255.402.839,83	0,117604				
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	94.136.920,85	0,00	0,00	7.402.333,37	101.539.254,22	7,863369				
FUNDOS DE INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	45.562.062,92	0,00	0,00	-183.060,99	45.379.021,93	-0,4011784				
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR						0,000000				
TOTAIS - PLANO PREVIDENC.	1.924.118.213,73	1.259.211.764,50	1.221.256.234,70	25.788.045,10	1.987.861.792,63	1,314326				
CARTEIRA TOTAL - PF + PP	6.177.138.945,44	2.084.441.160,12	2.032.677.220,83	77.444.806,27	6.306.347.691,00	1,245314				

Rentabilidade da carteira e Meta de rentabilidade em outubro 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.)



ESTADO DO AMAPÁ



AMAPÁ PREVIDÊNCIA - AMPREV
DIRETORIA FINANCEIRA E ATUARIAL - DIFAT
DIVISÃO DE INVESTIMENTOS E MERCADO - DIM

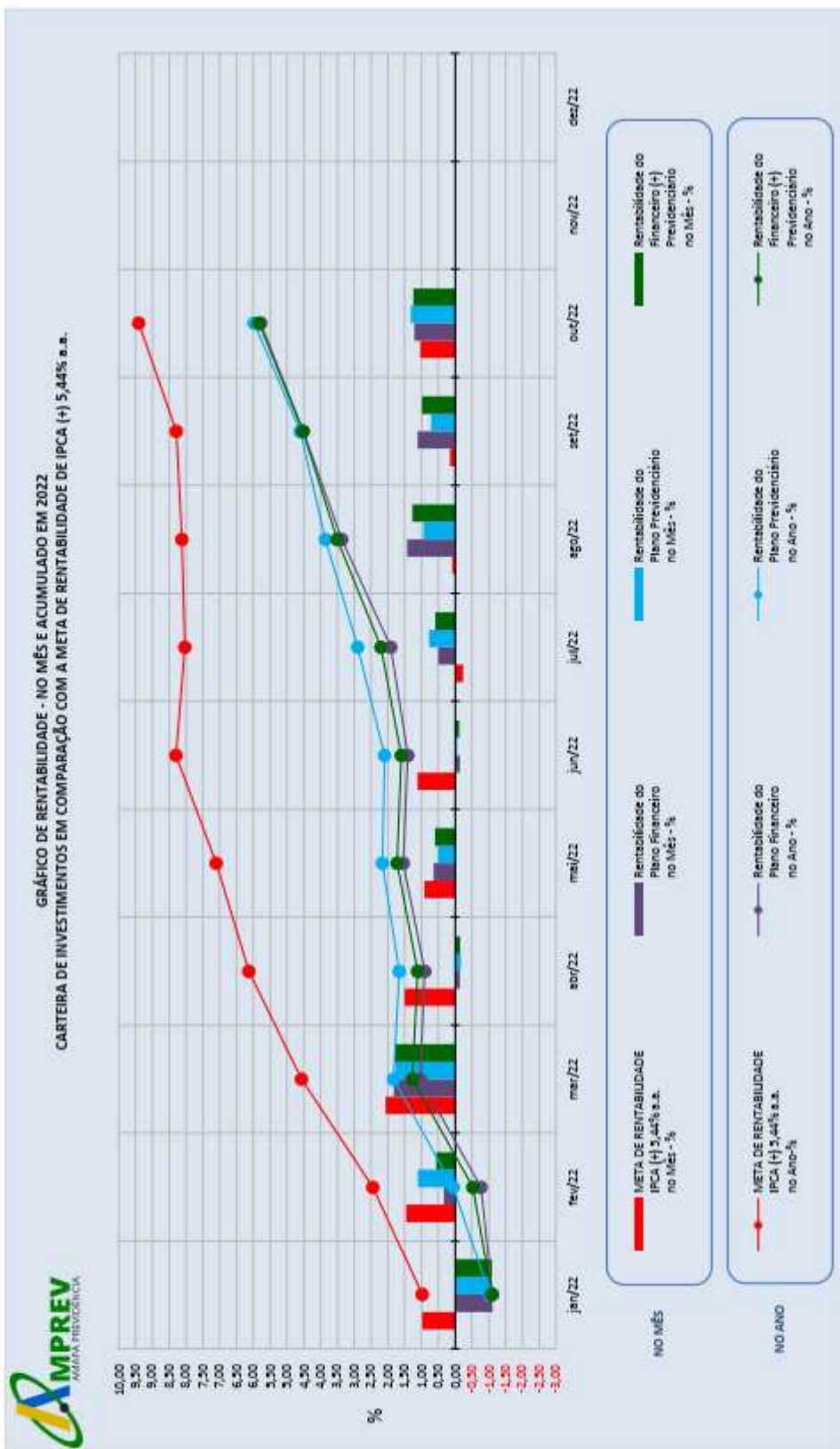
DEMONSTRATIVOS DE RENTABILIDADES DA CARTEIRA DA AMPREV - Somente Aplicações

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

MÊS	META DE RENTABILIDADE		PLANO FINANCEIRO		PLANO PREVIDENCIÁRIO		CONSOLIDAÇÃO PF + PP	
	META DE RENTABILIDADE IPCA (-) 5,44% a.a. no mês - %	META DE RENTABILIDADE PCA (-) 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 Plano Previdenciário no Mês - %	Rentabilidade do Plano Previdenciário no Ano - %
dez/21	0,962437	15,99953	-1,106399	-0,245591	-1,035381	0,585028	-1,087175	-0,025532
jan/22	1,452470	0,982437	0,337601	-1,106399	-1,035381	-1,035381	-1,087175	-1,087175
fev/22	2,062459	2,449177	1,823711	-0,774639	0,055722	0,055722	0,560345	-0,533021
mar/22	1,562456	4,562148	0,897414	1,034945	1,774056	1,830767	1,608939	1,262276
abr/22	0,912415	6,133117	0,541882	0,897414	-0,173152	1,654444	-0,147158	1,172254
mai/22	1,112465	7,101492	-0,139053	1,545057	0,497403	2,160077	0,598611	1,725553
jun/22	-0,237555	8,293960	0,504179	1,403855	-0,065551	2,093007	-0,116713	1,603830
jul/22	0,062455	6,035611	1,422255	1,915112	0,778902	2,888212	0,588882	2,202156
ago/22	0,152372	6,124742	1,116023	3,354605	0,942492	3,657925	1,272647	3,503033
set/22	1,032487	6,289494	1,210659	4,518177	0,717373	-4,602974	0,991509	4,532275
out/22		9,407568		5,783536		1,314325		5,818902
nov/22						5,977799		
dez/22								
Acumulado	9,417568		5,783536		5,977799		5,828502	



ESTADO DO AMAPÁ



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 à Meta de Rentabilidade - %	
jan-22	-80.652.220,59	54.809.023,60	-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	65,61	
jun-22	-6.889.907,66	65.672.164,43	-72.562.072,29	-10,49	
jul-22	35.033.404,54	-14.134.878,45	49.168.282,99	-247,86	
ago-22	76.486.772,29	4.955.018,89	71.534.753,40	1.543,68	
set-22	60.645.606,35	9.319.852,65	51.325.753,70	650,71	
out-22	77.444.906,27	64.312.982,07	13.132.224,20	120,42	
nov-22					
dez-22					
Acumulado	341.349.531,21	522.611.344,68	-181.261.813,47	61,96	

Conclusão

Ao COFISPREV cabe analisar se os procedimentos adotados para garantia dos investimentos estão dentro da legalidade, conforme parâmetros estabelecidos pelos órgãos reguladores. 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, órgão a quem compete os encaminhamentos para aplicação dos recursos.

Cumprindo **recomendar: i)** a inclusão nos autos da **ATA** (que aprovou os demonstrativos) e **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. 136, da Portaria n. 1.467, de 2 de junho de 2022 e **ii) os EXTRATOS FINANCEIROS DAS APLICAÇÕES.**

Em 26/04/2023, foi realizada reunião do Colegiado do COFISPREV/AMPREV, com o Sr. Carlos Roberto dos Anjos, coordenador do Comitê de Investimentos da AMPREV, oportunidade em que foi amplamente discutido e debatido sobre as informações de resgates, conforme disposto na ATA da 16ª Reunião Ordinária do CIAP/AMPREV, ocasião em que os membros do colegiado puderam compreender as razões de tais atos e, por unanimidade, conferiram conformidade aos Demonstrativo de Consolidação dos Ativos da Carteira de Investimentos dos Recursos dos Segurados do RPPS (Regime Próprio de Previdência dos Social) e RPPM (Regime Próprio de Previdência dos Militares) do Estado do Amapá, relativo

aos meses de julho a dezembro de 2022, nos termos da apresentação do distinto coordenador do CIAP.

Por todo o exposto, considerando que o mérito do ato administrativo está reservado a análise das instâncias competentes não sendo possível ao Conselho Fiscal substituí-las e por não haver qualquer ilegalidade passível de correção por esse colegiado, **voto pela conformidade dos atos realizados**, relativo ao Demonstrativo de Consolidação dos Ativos da Carteira de Investimentos dos Recursos dos Segurados do RPPS (Regime Próprio de Previdência dos Social) e RPPM (Regime Próprio de Previdência dos Militares) do Estado do Amapá, competência **outubro de 2022**.

Macapá – AP, 7 de junho de 2023.

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

Este relatório foi submetido para apreciação na nona reunião extraordinária realizada, no dia 7/06/2023, sendo aprovado por unanimidade, pelos demais membros do Conselho Fiscal da Amapá Previdência - COFISPREV, conforme abaixo.

Arnaldo Santos Filho - Conselheiro Titular

Jurandil dos Santos Juarez - Conselheiro Titular

Adriene Ribeiro Benjamin Pinheiro – Conselheira Titular

Thiago Lima Albuquerque – Conselheiro Suplente

Max Ferreira Barbosa - Conselheiro Suplente



CERTIDÃO

Certifico que para cumprimento da determinação do senhor **HELTON PONTES DA COSTA**, Vice-Presidente do Conselho Fiscal da Amapá Previdência, que a matéria **Apresentação da redação final do relatório/voto do Processo nº 2022.277.1101990PA**, que trata do **Demonstrativo de Investimentos do mês de outubro de 2022. (Relator Conselheiro Helton Pontes da Costa)**, foi objeto de apreciação pelo Conselho Fiscal da Amapá Previdência, na 9ª Reunião Extraordinária, no Item nº 7 de pauta realizada no dia 7/07/2023:

Decisão: Aprovado por unanimidade de votos a **Análise Técnica nº 038/2023-COFISPREV/AMPREV**, concluindo **pela conformidade dos atos realizados**, relativo ao Demonstrativo de Consolidação dos Ativos da Carteira de Investimentos dos Recursos dos Segurados do RPPS (Regime Próprio de Previdência dos Social) e RPPM (Regime Próprio de Previdência dos Militares) do Estado do Amapá, competência **outubro de 2022**.

Conselheiros presentes na reunião: **Max Ferreira Barbosa, Arnaldo Santos Filho, Thiago Lima Albuquerque, Jurandil dos Santos Juarez, Adriene Ribeiro Benjamin Pinheiro** e na Presidência da Sessão: **Helton Pontes da Costa**.

Do que para constar lavrei o presente termo.

Macapá-AP, 7 de junho de 2023.

JOSILENE DE SOUZA RODRIGUES
Secretária do Conselho Fiscal da Amapá Previdência – COFISPREV
Portaria nº 129/2013 – AMPREV



Cód. verificador: 171676329. Cód. CRC: 4013EDF
Documento assinado eletronicamente por **JOSILENE DE SOUZA RODRIGUES** em 24/07/2023 14:41, conforme decreto nº 0829/2018. A autenticidade do documento pode ser conferida no site:
<https://sigdoc.ap.gov.br/autenticador>

