

ANÁLISE TÉCNICA Nº 008/2024–COFISPREV/AMPREV.

PROCESSO: 2023.277.1102004PA.

OBJETO: Demonstrativo de Consolidação dos Ativos da Carteira de Investimentos dos Recursos dos Segurados do RPPS do Estado do Amapá, do mês de **maio/2023**.

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 2023.277.1102004PA**, cujo objeto versa sobre **Demonstrativo de Consolidação dos Ativos da Carteira de Investimentos** dos Recursos dos Segurados do RPPS do Estado do Amapá, **competência maio de 2023**.

Consta às **fl. 2** dos autos, **Ofício n. 130204.0077.1574.0092/2023 DIM – AMPREV**, datado de 16/06/2023, onde o Chefe da DIM (Divisão de Investimentos e Mercado) encaminha os autos para conhecimentos, deliberações e demais encaminhamentos.

Consta às **fl. 3-56** 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 maio de 2023, em planilhas, gráficos e demais informações com posição final no mês do Plano Financeiro e Plano Previdenciário, em cada produto de investimentos**.

Às **fl. 57** dos autos, consta **Despacho n. 130204.0077.1574.0092/2023, de 22/11/2023**, a encaminha o novo Demonstrativos de Investimentos de Maio – Retificado, e as ATAS de aprovação pelo Comitê para conhecimento e encaminhamentos.



Às **fl. 58-64**, consta a **ATA da 11ª Reunião Ordinária do CIAP do ano de 2023**, que aprovou o **demonstrativos de consolidação dos ativos da carteira de investimentos** dos recursos dos segurados do RPPS do Estado do Amapá, **do mês de maio de 2023**.

Às **fl. 65-100** dos autos, consta **Ofício n. 130204.0077.1574.0134/2023 DIM – AMPREV, de 28/08/2023**, da Chefia da DIM/DIFAT, com diversas informações, a informar de retificação dos referidos demonstrativos, devido a **FATO RELEVANTE do FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II, CNPJ 15.039.162/0001-00**, e **divergência detectada pela Divisão de Contabilidade-DICON** (Ofício N° 0315/2023-DICON/AMPREV) na movimentação da operação compromissada, no demonstrativo de caixa da **Carteira Administrada de Títulos Públicos Federais de gestão da Caixa Econômica Federal no Plano Previdenciário**.

Consta às **fl. 102-157** dos autos, **os novos demonstrativos de consolidação dos ativos da carteira de investimentos** dos recursos dos segurados do RPPS do Estado do Amapá, **do mês de maio de 2023**, **retificados, com os despachos a informar sobre a retificação nesse demonstrativo, devidos ao fato relevante e divergência, acima referenciada**.

Às **fl. 158-162**, consta a **ATA da 18ª Reunião Ordinária do CIAP do ano de 2023**, que aprovou o novo **demonstrativos de consolidação dos ativos da carteira de investimentos** dos recursos dos segurados do RPPS do Estado do Amapá, **do mês de maio de 2023, devidamente retificado**.

Em 05/01/2024, às fl. 167, esses autos foram encaminhados para nossa relatoria, recebidos em mídia digital, em 1 arquivo em PDF, contendo **167 páginas**.

É o que importa relatar.



Manifestação

Da Competência do Conselho Fiscal da AMPREV (COFISPREV/AMPREV)

Frise-se que a presente manifestação tem como objetivo analisar os atos da Diretoria Administrativa e demais prepostos com relação a aplicação de recursos no mercado financeiro, de acordo com o art. 106 e 107, da Lei Estadual n. 0915/2005, e art. 2º, inc. VII e XI, do Regimento Interno do Conselho Fiscal da AMPREV.

Insta esclarecer que o Conselho Fiscal da AMPREV não participa do processo de análise, de assessoramento e decisório sobre investimentos e a aplicação dos recursos dos regimes próprios RPPS e RPPM do Estado do Amapá, e sua atuação nessa seara visa tão somente verificar, em análise posterior, as referidas aplicações, e se os parâmetros definidos nas normas dos órgãos competentes sobre esses recursos estão sendo cumpridos.

É importante mencionar que compulsando esses autos digitais originais observei **não constar** as seguintes informações:

- 1) o **RELATÓRIO** detalhado com informações sobre rentabilidade, os riscos das diversas modalidades de operações realizadas nas aplicações do regime e aderência à política de investimentos (**cf. art. 136, Portaria n. 1.467/22**);
- 2) os **EXTRATOS FINANCEIROS DAS APLICAÇÕES** (**cf. art. 149, Portaria n. 1.467/22**); e
- 3) **Manifestação do órgão de Controle Interno da Instituição (Divisão de Auditoria Interna)**, a exercer de modo contínuo o monitoramento e a fiscalização dos processos de investimentos e sua aderência à Política de Investimentos em vigor (cf. atribuições conforme **Ato Normativo nº 005/2023-DIEX/AMPREV – Manual de**

Atribuições da AMPREV, c/c art. 125 e art. 126, Portaria n. 1.467/22).

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 **2023, aprovado conforme Resolução n. 12/2022-CEP/AP**, tendo como um dos seus objetivos estabelecer as diretrizes para aplicação no mercado financeiro, no exercício de 2023, dos recursos garantidores dos benefícios dos Regimes Próprio do Estado do Amapá, definidos na **Lei nº 0915/2005** e suas alterações e **Lei nº 1.813/2014**, conforme estabelece a Resolução do Conselho Monetário nº **4.963/2021**.

Os critérios, procedimentos e limites estabelecidos para aplicação dos recursos financeiros administrados pela Amapá Previdência-AMPREV são regulados pela **Resolução CMN Nº 4.963/2021 e pela Portaria MTP Nº 1.467/2022**, bem como pelo Pró-Gestão, conforme nível de certificação obtido junto à Secretaria de Previdência do Ministério do Trabalho e Previdência, devendo ser adequado às características dos planos financeiro e previdenciário com base em suas obrigações futuras, buscando atingir ou superar a meta de rentabilidade prevista, observado o equilíbrio dos ativos com as obrigações do passivo atuarial.



Das informações dos autos dos demonstrativos de investimento de maio de 2023:

As aplicações dos recursos dos segurados do RPPS do Estado do Amapá, do Plano Financeiro e Plano Previdenciário, obedecem às diretrizes e princípios contidos na Política Anual de Investimentos, aprovada pelo Conselho Estadual de Previdência-CEP e estabelecida em consonância com os dispositivos da legislação em vigor, em específico a Resolução Nº4.963/2021-CMN e Portaria MTP Nº 1.467/2022.

A Amapá Previdência-AMPREV é a Unidade Gestora responsável pela administração dos recursos, que são aplicados de forma a buscar retorno equivalente ou superior à meta de rentabilidade prevista de **IPCA + 5,44% a.a.**, no que for possível e no limite das variantes do mercado financeiro, observando sempre, a adequação do perfil de risco dos segmentos de investimentos, respeitando as necessidades de mobilidade de investimentos e de liquidez adequadas ao atendimento dos compromissos atuariais.

Da Retificação dos Demonstrativos de Consolidação dos Ativos da Carteira de Investimentos de Maio/2023

Para fins de melhor compreensão entendo oportuno colacionar na íntegra as informações sobre a retificação conforme **Ofício n. 130204.0077.1574.0134/2023 DIM – AMPREV, de 28/08/2023**, da Chefia da DIM/DIFAT, nestes termos:

OFÍCIO Nº 130204.0077.1574.0134/2023 DIM - AMPREV

Macapá-AP, 28 de agosto de 2023

A(o) DIRETORIA FINANCEIRA E ATUARIAL - DIFAT

Assunto: RETIFICAÇÃO DO DEMONSTRATIVO DE CONSOLIDAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DE MAIO/2023.

Senhora Diretora,

Encaminhamos o Demonstrativo de Consolidação dos Ativos da Carteira da AMPREV de **MAIO/2023**, retificado, conforme explicações a seguir.

Conforme explanado no OFÍCIO Nº 0110/2023-DIM/AMPREV, sobre FATO RELEVANTE do FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II, CNPJ 15.039.162/0001-00, o administrador do fundo, a Lions Trust Administradora de Recursos Ltda, informa sobre impacto no valor das cotas do fundo, oriundo da baixa de valores considerados ativos contingentes, os quais referem-se as parcelas de Earn-out e Holdback da venda do grupo ABC, conforme exigido pelos auditores independentes, com data de 28/02/2023.

Em virtude do Fato Relevante, o administrador reprocessou (recalculou) as cotas do fundo de fevereiro à junho de 2023, emitindo novos extratos dessas competências com alterações no valor da cota, nos rendimentos e saldos finais.

O reprocessamento dos meses, nos obrigou a reprocessar todos os DEMONSTRATIVO DE CONSOLIDAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DOS RECURSOS DOS SEGURADOS DO RPPS DO ESTADO DO AMAPÁ, de fevereiro a junho/2023, pois alterações nos rendimentos de qualquer fundo, causam alteração nas rentabilidades e rendimentos totais da carteira da AMPREV. O resumo das alterações no fundo estão no Anexo I.



Outro motivo de retificação é a divergência detectada pela Divisão de Contabilidade-DICON (Ofício N° 0315/2023-DICON/AMPREV) na movimentação da operação compromissada, no demonstrativo de caixa da Carteira Administrada de Títulos Públicos Federais de gestão da Caixa Econômica Federal no Plano Previdenciário. Na demonstração de compra e venda diária da operação compromissada lastreada em TPF, a partir de fevereiro/2023, a Caixa incluiu no movimento de cada mês, a movimentação do último dia útil do mês anterior, quando o correto é incluir as movimentações ocorridas do primeiro ao último dia útil do mês. Isso ocorreu de fevereiro a maio de 2023.

Essa inclusão foi equivocada, por parte da gestão da Caixa Econômica, pois gerava aumento dos valores de compra, venda e rendimentos das operações compromissadas lastreadas em TPF, sendo que em 18/07/2023 a Caixa encaminhou a retificação dos demonstrativos de caixa e cota gerencial devidamente ajustados, de fevereiro a maio de 2023. O resumo das alterações no fundo estão no Anexo II.

Os recálculos dos fundos acima alteram os resultados totais do patrimônio líquido da carteira da AMPREV, principalmente o valor do rendimento líquido acumulado no ano, o qual foi ajustado para demonstrar a rentabilidade em comparação com a meta de rentabilidade de IPCA +5,44 a.a., bem como o rendimento. O resumo das alterações do patrimônio líquido da carteira está no Anexo III.

Também, em virtude das alterações, foram alterados o Demonstrativo das Aplicações e Investimentos dos Recursos-DAIR do Sistema de Cadastro de Regimes Próprios de Previdência Social-CADPREV do Ministério da Previdência Social e os lançamentos do Sistema de Atlas, de controle de investimentos dos RPPS.

Conforme explanado, segue o demonstrativo de **MAIO/2023** retificado para conhecimento, avaliação, e procedimentos em relação aos registros contábeis, bem como para análise e aprovação, conforme competências da Diretoria Executiva, CIAP, COFISPREV e CEP, sendo que está disponível em PDF a todos os conselhos e Diretoria Executiva da AMPREV nos arquivos da DIM.

Atenciosamente,

CARLOS ROBERTO DOS ANJOS OLIVEIRA
Chefe De Divisão (DIM - DIVISÃO DE INVESTIMENTOS E MERCADO)
(Assinado Eletronicamente)



ANEXO I

FIP MULTISTRATÉGIA KINEA PRIVATE EQUITY II - ANTES DA OCORRÊNCIA DO FATO RELEVANTE											
FIP MULTISTRATÉGIA KINEA PRIVATE EQUITY II						15.039.162/0001-00		Início da Aplic.: outubro-22			
MÊS	Valor da Cota R\$	Rentab. do Fundo no Mês %	IPCA - %	Meta de Rentabilidade no Mês %	% da Meta de Rentabilidade	MOVIMENTAÇÕES DEMONSTRADAS NO EXTRATO DO FUNDO POR MÊS - R\$ (Espelho)					
						SALDO MÊS ANTERIOR	APLICADO	AMORTIZAÇÃO	RENDIMENTO (+ / -)	SALDO	
fev/23	231.22384150	0,814530	0,84	1,282400	63,52	2.034.190,96			16.569,11	2.050.760,07	
mar/23	233.88913789	1,152891	0,71	1,152442	100,02	2.050.760,07			23.638,92	2.074.398,99	
abr/23	230.85878922	-1,295635	0,61	1,052423	-123,11	2.074.398,99		40.631,53	13.754,90	2.047.522,36	
mai/23	232.30998185	0,628606	0,23	0,672333	93,50	2.047.522,36			12.870,85	2.060.393,21	
jun/23	234.53264302	0,956765	-0,08	0,362441	263,98	2.060.393,21			19.713,13	2.080.106,34	
INFORMAÇÕES DO REGULAMENTO DO FUNDO / CVM						DESCRIÇÃO	RENTABILIDADES DO PRODUTO - %				
Administrad.:	Lions Trust Administradora de Recursos Ltda.					PERÍODO ---->	NO MÊS	06 MESES	ANO 2023	12 MESES	
Gestor:	Kinea Private Equity Investimentos S.A.					Rentab. Fundo-%	0,956765	3,405958	3,405958	2,108171	
Custodiante:	Banco Bradesco S.A.					Meta de Rentabil.%	0,362441	5,618738	5,618738	8,758630	
Distribuidor:	Banco Itaú Unibanco S.A.					% da Meta Rentab	263,98	60,62	60,62	24,07	
Invest.:5 anos	Desinv.:3 anos	Quant. de Cotas - UND: 8.869,154901000				Volatilidade Mensal - 12 Meses - % :	1,98		Saldo Final:	2.080.106,34	
Patrim. Líq. do Fundo - R\$:		167.346.311,31		Referência:	IPCA+8%a.a.	Participação da Aplicação em Relação ao PL do Fundo - % :			1,24%		
Subscrição:		R\$ 10.000.000,00		Fundo de Reserva:	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLAÇÃO 5 - FIC FI						



FIP MULTIESTRATÉGIA KINEA PRIVATE EQUITY II - APÓS A OCORRÊNCIA DO FATO RELEVANTE - REMARCAÇÃO DE COTA A PARTIR DE FEV-2023											
FIP MULTIESTRATÉGIA KINEA PRIVATE EQUITY II						15.039.162/0001-00		Início da Aplic.: outubro-22			
MÊS	Valor da Cota R\$	Rentab. do Fundo no Mês %	IPCA - %	Meta de Rentabilidade no Mês %	% da Meta de Rentabilidade	MOVIMENTAÇÕES DEMONSTRADAS NO EXTRATO DO FUNDO POR MÊS - R\$ (Espelho)					
						SALDO MÊS ANTERIOR	APLICADO	AMORTIZAÇÃO	RENDIMENTO (+ / -)	SALDO	
fev/23	215,70977182	-5,949667	0,84	1,282400	-463,95	2.034.190,96			-121.027,58	1.913.163,38	
mar/23	217,95165795	1,039307	0,71	1,152442	90,18	1.913.163,38			19.883,64	1.933.047,02	
abr/23	214,58614977	-1,544154	0,61	1,052423	-146,72	1.933.047,02		40.631,53	10.782,31	1.903.197,80	
mai/23	215,62449850	0,483884	0,23	0,672333	71,97	1.903.197,80			9.209,28	1.912.407,08	
jun/23	217,90544243	1,057832	-0,08	0,362441	291,86	1.912.407,08			20.230,04	1.932.637,12	
INFORMAÇÕES DO REGULAMENTO DO FUNDO / CVM						DESCRIÇÃO	RENTABILIDADES DO PRODUTO - %				
Administrad.:	Lions Trust Administradora de Recursos Ltda.					PERÍODO ---->	NO MÊS	06 MESES	ANO 2023	12 MESES	
Gestor:	Kinea Private Equity Investimentos S.A.					Rentab. Fundo-%	1,057832	(3,925011)	(3,925011)	(5,130792)	
Custodiante:	Banco Bradesco S.A.					Meta de Rentabil.%	0,362441	5,618738	5,618738	8,758630	
Distribuidor:	Banco Itaú Unibanco S.A.					% da Meta Rentab	291,86	-69,86	-69,86	-58,58	
Invest.:5 anos	Desinv.:3 anos	Quant. de Cotas - UND:		8.869,154901000		Volatilidade Mensal - 12 Meses - % :	2,64		Saldo Final:	1.932.637,12	
Patrim. Líq. do Fundo - R\$:		155.482.288,24		Referência:	IPCA+8%a.a.	Participação da Aplicação em Relação ao PL do Fundo - % :			1,24%		
Subscrição:		R\$ 10.000.000,00		Fundo de Reserva:	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLAÇÃO 5 - FIC FI						

Após remarcação da cota, o recurso de titularidade da AMPREV, até junho/23, no FIP MULTIESTRATÉGIA KINEA PRIVATE EQUITY II, passou de R\$ 2.080.106,34 para R\$ 1.932.637,12, o que reduziu o patrimônio líquido da carteira da AMPREV, sendo que essa redução ocorreu em cada mês, de fevereiro a junho de 2023, conforme demonstrativos acima.



ANEXO II

CARTEIRA ADMINISTRADA DE TPF DE GESTÃO DA CAIXA ECONÔMICA - ANTES DO EQUÍVOCO DETECTADO PELA DICON/AMPREV										
CARTEIRA ADMINISTRADA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS - GESTÃO CAIXA ECONÔMICA FEDERAL									Início da Aplic.: fevereiro-05	
MÊS	Valor da Cota R\$	Rentab. do Fundo no Mês %	IPCA - %	Meta de Rentabilidade no Mês %	% da Meta de Rentabilidade	MOVIMENTAÇÕES DEMONSTRADAS NO EXTRATO DO FUNDO POR MÊS - R\$ (Espelho)				
						SALDO MÊS ANTERIOR	COMPRA T.P.F./ Oper. Compr. (*)	VENDA T.P.F. Cupom/Op.Comp.(*)	RENDIMENTO (+ / -)	SALDO
fev/23	2,904200	1,350550	0,84	1,282400	105,31	329.345.318,04	659.436.654,13	659.465.484,61	4.475.887,45	333.792.375,01
mar/23	2,947000	1,473728	0,71	1,152442	127,88	333.792.375,01	896.844.917,64	896.868.735,06	4.924.793,84	338.693.351,43
abr/23	2,972100	0,851714	0,61	1,052423	80,93	338.693.351,43	745.035.785,52	745.068.329,12	2.916.988,48	341.579.796,31
mai/23	2,992223	0,677049	0,23	0,672333	100,70	341.579.796,31	698.893.923,10	698.917.113,43	2.331.072,09	343.887.678,07
INFORMAÇÕES DO CONTRATO						DESCRIÇÃO	RENTABILIDADES DO PRODUTO - %			
Administrad.:	Caixa Economica Federal					PERÍODO ---->	NO MÊS	06 MESES	ANO 2023	12 MESES
Gestor:	Caixa Economica Federal					Rentab. Fundo-%	0,677049	6,853643	5,844449	9,979879
Custodiante:	Caixa Economica Federal					Meta de Rentabil. %	0,672333	6,355331	5,237314	9,571400
Distribuidor:						% da Meta Rentab	100,70	107,84	111,59	104,27
Aplic.: D+0	Resg.: D+4	Quant. de Cotas - UND:				Volatilidade Mensal - 12 Meses - % :	0,60	Saldo Final:		343.887.678,07
Patrim. Líq. do Fundo - R\$:				Referência:	INPC+6%a.a.	Participação da Aplicação em Relação ao PL do Fundo - % :				

CARTEIRA ADMINISTRADA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS - GESTÃO CAIXA ECONÔMICA FEDERAL											
										Início da Aplic.: fevereiro-05	
MÊS	Valor da Cota R\$	Rentab. do Fundo no Mês %	IPCA - %	Meta de Rentabilidade no Mês %	% da Meta de Rentabilidade	MOVIMENTAÇÕES DEMONSTRADAS NO EXTRATO DO FUNDO POR MÊS - R\$ (Espelho)					
						SALDO MÊS ANTERIOR	COMPRA T.P.F./ Oper. Compr. (*)	VENDA T.P.F. Cupom/Op.Comp.(*)	RENDIMENTO (+ / -)	SALDO	
fev/23	2,904200	1,350550	0,84	1,282400	105,31	329.345.318,04	626.540.494,66	626.568.961,68	4.475.523,99	333.792.375,01	
mar/23	2,947000	1,473728	0,71	1,152442	127,88	333.792.375,01	859.675.052,22	859.698.646,47	4.924.570,87	338.693.351,43	
abr/23	2,972100	0,851714	0,61	1,052423	80,93	338.693.351,43	741.744.047,46	741.775.108,37	2.917.505,79	341.579.796,31	
mai/23	2,992223	0,677049	0,23	0,672333	100,70	341.579.796,31	685.389.730,66	685.412.127,68	2.330.278,78	343.887.678,07	
INFORMAÇÕES DO CONTRATO						DESCRIÇÃO	RENTABILIDADES DO PRODUTO - %				
Administrad.:	Caixa Economica Federal					PERÍODO ---->	NO MÊS	06 MESES	ANO 2023	12 MESES	
Gestor:	Caixa Economica Federal					Rentab. Fundo-%	0,677049	6,853643	5,844449	9,979879	
Custodiante:	Caixa Economica Federal					Meta de Rentabil. %	0,672333	6,355331	5,237314	9,571400	
Distribuidor:						% da Meta Rentab	100,70	107,84	111,59	104,27	
Aplic.: D+0	Resg.: D+4	Quant. de Cotas - UND:				Volatilidade Mensal - 12 Meses - % :	0,60		Saldo Final:	343.887.678,07	
Patrim. Líq. do Fundo - R\$:				Referência: INPC+6%a.a.		Participação da Aplicação em Relação ao PL do Fundo - % :					

Após retificação, não houve redução no recurso de titularidade da AMPREV, até maio/23, na CARTEIRA ADMINISTRADA DE TPF do PP, as mudanças ocorreram nos valores de compra e venda de TPF e nos valores de rendimentos, dos meses de fevereiro a maio de 2023, conforme demonstrativos acima.

ANEXO III

PATRIMÔNIO LÍQUIDO DA AMPREV ANTES DA REMARCAÇÃO DO FIP KINEA II e RETIFICAÇÃO DA CART. ADMIN. DE TPF DA CAIXA.						
MÊS/ANO	PLANO FINANCEIRO		PLANO PREVIDENCIÁRIO		TOTAL FINANC. + PREVIDENC.	
	POSIÇÃO	RENDIMENTO LÍQ.	POSIÇÃO	RENDIMENTO LÍQ.	POSIÇÃO	RENDIMENTO LÍQ.
fev-23	4.428.001.133,35	26.203.311,46	2.152.396.514,15	14.377.748,94	6.580.397.647,50	40.581.060,40
mar-23	4.486.454.925,20	53.038.253,35	2.217.008.663,67	32.077.620,46	6.703.463.588,87	85.115.873,81
abr-23	4.549.069.016,69	49.160.304,95	2.253.663.634,66	22.607.316,33	6.802.732.651,35	71.767.621,28
mai-23	4.622.195.586,94	71.485.451,04	2.297.654.490,42	29.270.851,04	6.919.850.077,36	100.756.302,08
jun-23	4.682.914.662,38	66.493.047,36	2.336.429.242,86	29.469.301,65	7.019.343.905,24	95.962.349,01
		266.380.368,16		127.802.838,42		394.183.206,58

PATRIMÔNIO LÍQUIDO DA AMPREV APÓS REMARCAÇÃO DO FIP KINEA II e RETIFICAÇÃO DA CART. ADMIN. DE TPF DA CAIXA.						
MÊS/ANO	PLANO FINANCEIRO		PLANO PREVIDENCIÁRIO		TOTAL FINANC. + PREVIDENC.	
	POSIÇÃO	RENDIMENTO LÍQ.	POSIÇÃO	RENDIMENTO LÍQ.	POSIÇÃO	RENDIMENTO LÍQ.
fev-23	4.427.863.536,66	26.065.714,77	2.152.396.514,15	14.377.385,48	6.580.260.050,81	40.443.100,25
mar-23	4.486.313.573,23	53.034.498,07	2.217.008.663,67	32.077.397,29	6.703.322.236,90	85.111.895,36
abr-23	4.548.924.692,13	49.157.332,36	2.253.663.634,66	22.607.833,64	6.802.588.326,79	71.765.166,00
mai-23	4.622.047.600,81	71.481.789,47	2.297.654.490,42	29.270.057,73	6.919.702.091,23	100.751.847,20
jun-23	4.682.767.193,16	66.493.564,27	2.336.429.242,86	29.469.301,65	7.019.196.436,02	95.962.865,92
		266.232.898,94		127.801.975,79		394.034.874,73

Após remarcação da cota do FIP KINEA II (PF) e retificação da Carteira Administrada de TPF de gestão da Caixa Econômica (PP) houve redução do patrimônio líquido e rendimento acumulado do Plano Financeiro e redução do rendimento do Plano Previdenciário, consequentemente houve redução do Patrimônio Líquido total e rendimento total da carteira da AMPREV.

Em resumo, o patrimônio total acumulado (PF +PP), que era de R\$ 7.019.343.905,24 passou para R\$ 7.019.196.436,02, representando uma redução de R\$ 147.469,22.

Em relação ao total do rendimento acumulado (PF +PP), que era de R\$ 394.183.206,58, passou para R\$ 394.034.874,73, representando uma redução de R\$ 148.331,85.

Das aplicações dos investimentos

A Amapá Previdência, objetivando seguir as diretrizes estabelecidas em sua Política de Investimentos, através da gestão ativa do CIAP, aplica seus recursos financeiros disponíveis em operações financeiras que busquem trazer o menor risco, a maior liquidez e a maior rentabilidade possível, através dos diversos estudos de análise e avaliação dos produtos e das instituições financeiras, seus gestores, administradores e outros agentes envolvidos, sempre observando a possibilidade do cumprimento da Meta de Rentabilidade. Segue algumas informações contidas nos autos:



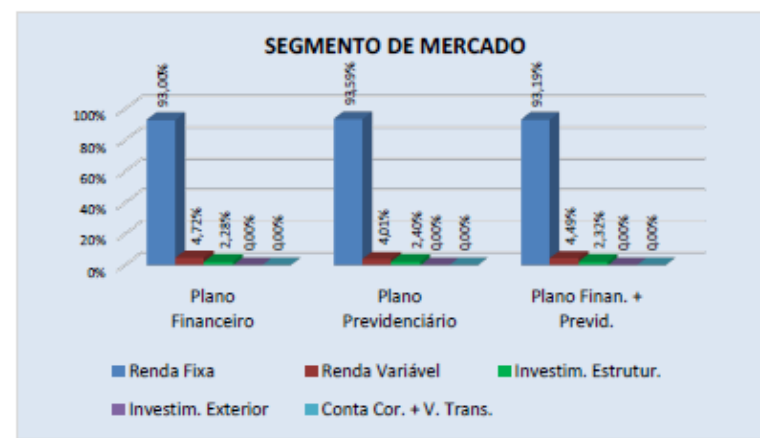
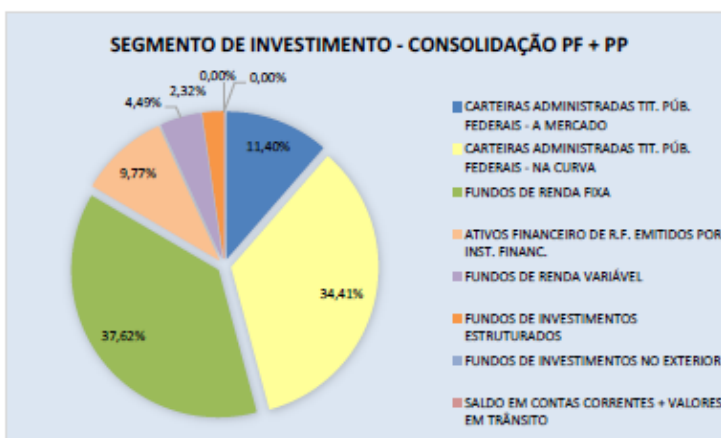
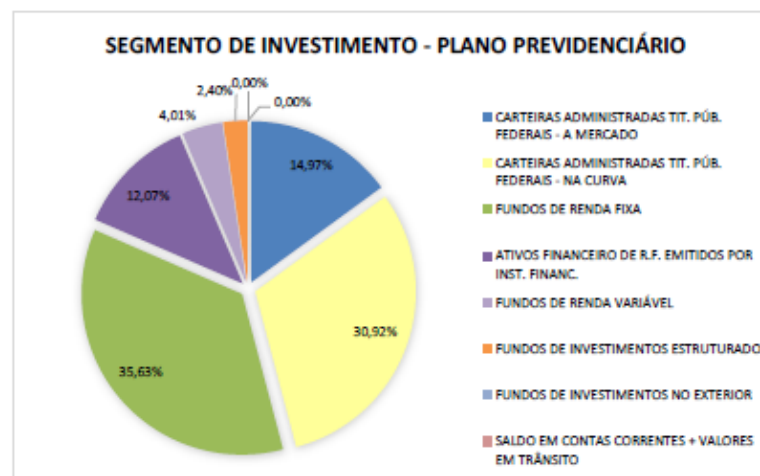
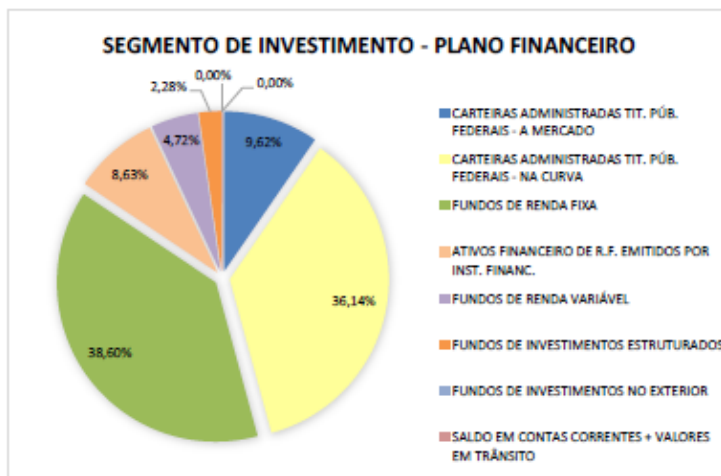
AMAPÁ PREVIDÊNCIA - AMPREV
DIRETORIA FINANCEIRA E ATUARIAL - DIFAT
DIVISÃO DE INVESTIMENTOS E MERCADO - DIM

**DEMONSTRATIVO DE CONSOLIDAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA
DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO E ENQUADRAMENTO LEGAL
POSIÇÃO: MAIO/2023 - EM 31/05/2023**

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	444.796.445,52	9,62%	12.913.156,57	343.887.678,07	14,97%	2.330.278,78	788.083.123,59	11,40%	15.243.435,35
CARTEIRAS ADMINISTRADAS TIT. PUB. FEDERAIS - NA CURVA	Renda Fixa	1.670.619.236,01	36,14%	18.208.239,53	710.456.889,83	30,92%	7.661.924,68	2.381.076.125,64	34,41%	25.870.164,21
FUNDOS DE RENDA FIXA	Renda Fixa	1.784.323.707,89	38,60%	22.207.014,14	818.627.768,76	35,63%	11.263.242,52	2.002.051.470,65	37,02%	33.470.250,00
ATIVOS FINANCEIRO DE R.F. EMITIDOS POR INST. FINANC.	Renda Fixa	398.760.640,17	8,63%	4.760.192,46	277.326.632,06	12,07%	3.371.242,73	676.087.272,23	9,77%	8.131.435,19
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	Renda Variável	218.210.063,67	4,72%	12.829.189,06	92.175.593,73	4,01%	4.861.479,87	310.385.657,40	4,40%	17.000.008,03
FUNDOS DE INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	Investim. Estruturados	105.168.883,22	2,28%	563.997,71	55.178.805,59	2,40%	-218.110,85	100.347.688,81	2,32%	345.880,80
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Investimentos Exterior		0,00%			0,00%			0,00%	
SUBTOTAL - SOMENTE RECURSOS APLICADOS		4.621.877.976,48		71.481.789,47	2.297.653.368,04		29.270.057,73	8.918.531.344,52		100.751.847,20
SALDO EM CONTAS CORRENTES + VALORES EM TRÂNSITO		169.624,33	0,00%		1.122,38	0,00%		170.746,71	0,00%	
TOTAIS		4.622.047.600,81	100,00%	71.481.789,47	2.297.654.490,42	100,00%	29.270.057,73	8.918.702.091,23	100,00%	100.751.847,20



GRÁFICOS DE DEMONSTRAÇÃO DOS SEGMENTOS DE INVESTIMENTO E MERCADO



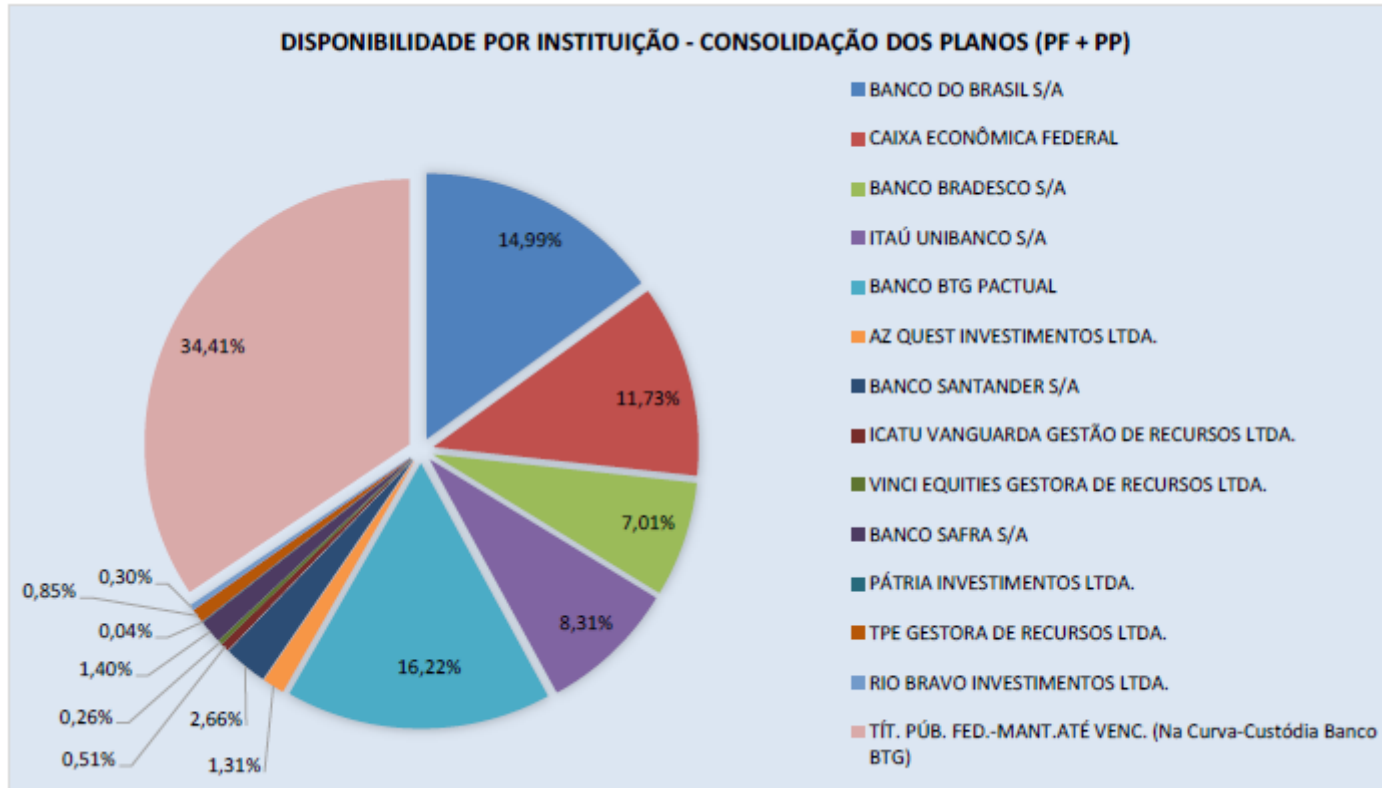


AMAPÁ PREVIDÊNCIA - AMPREV
DIRETORIA FINANCEIRA E ATUARIAL - DIFAT
DIVISÃO DE INVESTIMENTOS E MERCADO - DIM

**DEMONSTRATIVO DE CONSOLIDAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA
DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO E ENQUADRAMENTO LEGAL
POSIÇÃO: MAIO/2023 - EM 31/05/2023**

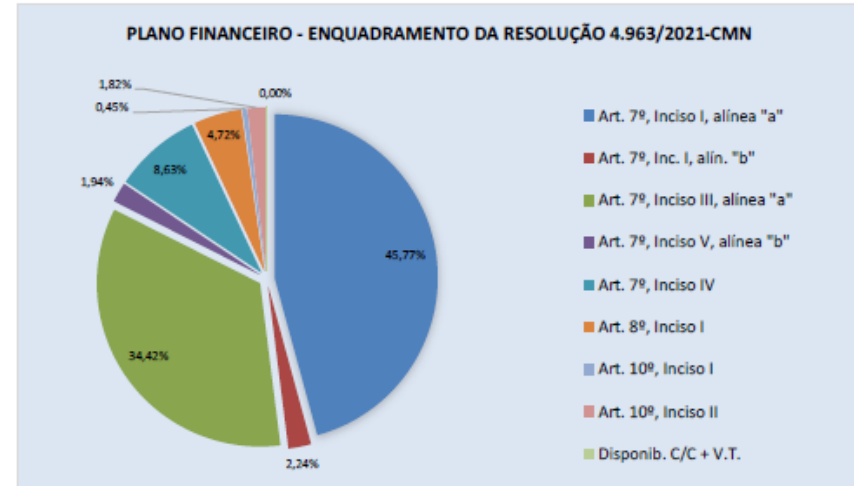
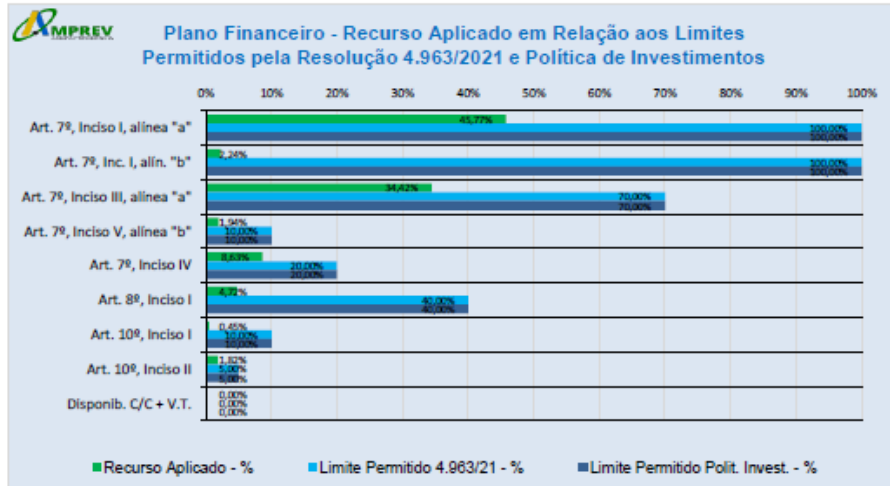
RESUMO DA DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - Produtos de Investimento e Saldo de Contas Correntes

INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	PLANO FINANCEIRO - PF				PLANO PREVIDENCIÁRIO - PP				DISPONIBILID. TOTAL - PF + PP	
	Aplicações - R\$	Saldo CIC+VT - R\$	Total Instituiç.-R\$	Particip. %	Aplicações - R\$	Saldo CIC+VT - R\$	Total Instituiç.-R\$	Particip. %	Total Instituiç.-R\$	Particip. %
BANCO DO BRASIL S/A	781.555.613,61	161.408,92	781.717.022,53	16,91%	255.823.936,06	0,00	255.823.936,06	11,13%	1.037.540.958,59	14,99%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	205.110.972,43	2.332,40	205.113.304,83	4,44%	606.346.195,55	403,35	606.346.598,90	26,39%	811.459.903,73	11,73%
BANCO BRADESCO S/A	380.112.866,08	2.478,90	380.115.344,98	8,22%	104.807.876,53	0,00	104.807.876,53	4,56%	484.923.221,51	7,01%
ITAÚ UNIBANCO S/A	419.014.982,27	3.403,89	419.018.386,16	9,07%	156.305.206,60	719,03	156.305.925,63	6,80%	575.324.311,79	8,31%
BANCO BTG PACTUAL	808.173.528,59	0,00	808.173.528,59	17,49%	314.095.283,81	0,00	314.095.283,81	13,67%	1.122.268.812,40	16,22%
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	58.606.264,22	0,00	58.606.264,22	1,27%	32.356.759,44	0,00	32.356.759,44	1,41%	90.963.023,66	1,31%
BANCO SANTANDER S/A	135.349.249,99	0,22	135.349.250,21	2,93%	48.561.066,44	0,00	48.561.066,44	2,11%	183.910.316,65	2,66%
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA.	22.575.314,98	0,00	22.575.314,98	0,49%	12.762.645,51	0,00	12.762.645,51	0,56%	35.337.960,49	0,51%
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA.			0,00	0,00%	17.687.655,44	0,00	17.687.655,44	0,77%	17.687.655,44	0,26%
BANCO SAFRA S/A	72.270.659,79	0,00	72.270.659,79	1,56%	24.758.777,20	0,00	24.758.777,20	1,08%	97.029.436,99	1,40%
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA.	2.697.885,20	0,00	2.697.885,20	0,06%			0,00	0,00%	2.697.885,20	0,04%
TPE GESTORA DE RECURSOS LTDA.	44.821.576,08	0,00	44.821.576,08	0,97%	13.691.075,63	0,00	13.691.075,63	0,60%	58.512.651,71	0,85%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA.	20.969.827,23	0,00	20.969.827,23	0,45%			0,00	0,00%	20.969.827,23	0,30%
TÍT. PÚB. FED.-MANT.ATÉ VENC. (Na Curva-Custódia Banco BTG)	1.670.619.236,01	0,00	1.670.619.236,01	36,14%	710.456.889,83	0,00	710.456.889,83	30,92%	2.381.076.125,84	34,41%
TOTAIS	4.621.877.976,48	169.624,33	4.622.047.600,81	100,00%	2.297.653.368,04	1.122,38	2.297.654.490,42	100,00%	6.919.702.091,23	100,00%

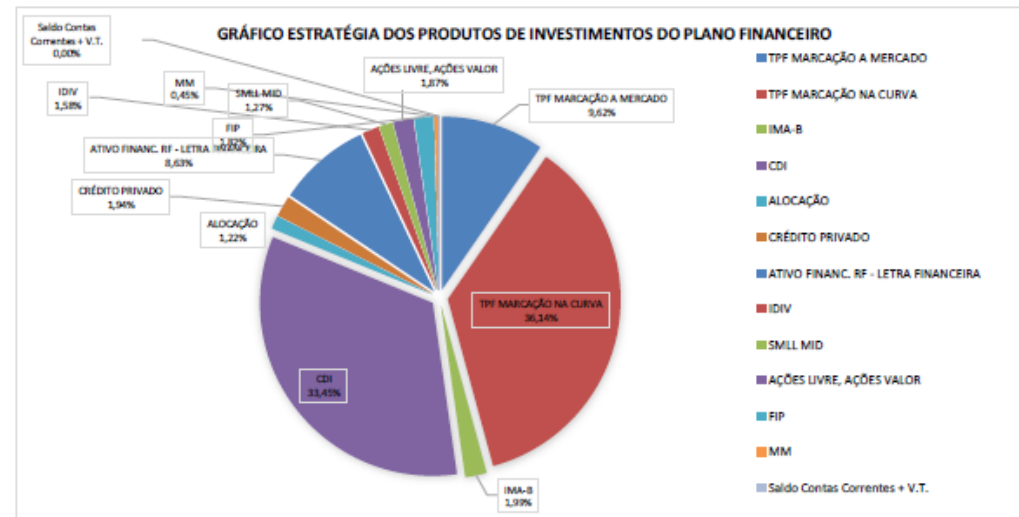


PLANO FINANCEIRO - DEMONSTRATIVO DE ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS DA CARTEIRA															
ENQUADRAMENTO LEGAL DA CARTEIRA DA AMPREV - LIMITES DA RESOLUÇÃO 4.963/2021-CMN com Vinculação à Nota Técnica SEI Nº 12/2017-CGACI/SRPPS/SPREV/MF E POLÍTICA DE INVESTIMENTOS															
POSIÇÕES DA CARTEIRA				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 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."	225.561.164,09	4,88%			2.115.414.681,53	Art. 7º, Inciso I, alínea "a"	45,77%	100,00%	100,00%					
Carteira Administrada de TPF BTG Pactual	TPF - "M.MERC."	219.234.281,43	4,74%												
Carteira Admin. de TPF na Curva-Custódia Banco BTG Pactual-PF	TPF - "M.CURVA"	1.670.619.236,01	36,14%												
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	IMA-B	31.303.453,09	0,68%	447.876.024,07	6,99%	103.574.112,88	Art. 7º, Inc. I, alin. "b"	2,24%	100,00%	100,00%					
Safra Soberano Regime Próprio FIC de FI RF Referenciado DI	CDI	72.270.659,79	1,56%	5.158.691.701,67	1,40%										
FIC FI Caixa Novo Brasil Renda Fixa Referenciado IMA-B LP	IMA-B	29.805.071,78	0,64%	1.265.571.591,84	2,36%	1.591.088.762,31	Art. 7º, Inciso III, alínea "a"	34,42%	70,00%	70,00%					
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	IMA-B	30.967.300,34	0,67%	351.371.380,62	8,81%										
FI Caixa Brasil RF Referenciado DI Longo Prazo	CDI	175.305.900,65	3,79%	15.982.419.153,18	1,10%										
BB Previdenciário Fluxo Renda Fixa Simples FIC FI	CDI	105.385.794,19	2,22%	3.860.323.166,27	2,73%										
Itau Institucional Alocação Dinâmica Renda Fixa FIC FI	ALOCACÃO	56.561.901,49	1,22%	2.062.404.983,41	2,74%										
Itau Soberano Renda Fixa Simples LP FICFI	CDI	161.331.848,78	3,92%	40.509.656.994,14	0,45%										
BTG Pactual Tesouro Sello FI RF Referenciado DI	CDI	247.567.009,99	5,36%	13.081.140.366,94	1,89%										
Bradesco FI RF Referenciado DI Federal Extra	CDI	264.287.462,77	5,72%	10.734.055.017,35	2,46%										
Santander RF Referenciado DI Institucional Premium FIC FI	CDI	49.267.816,99	1,07%	3.184.616.150,75	1,55%										
BB Previdenciário Renda Fixa Referenciado DI LP Perfil FIC FI	CDI	450.608.655,33	9,75%	15.420.425.695,62	2,92%										
BTG Pactual Credito Corporativo I FIQ de FI de RF Cred. Priv. LP	CRÉDITO PRIVADO	89.660.832,70	1,94%	2.375.453.512,69	3,77%						89.660.832,70	Art. 7º, Inciso V, alínea "b"	1,94%	10,00%	10,00%
Bradesco - Letra Financeira - Prazo 05 Anos - LF0022009M7	AT.FIN. RF - LF	34.453.401,79	0,75%								398.760.640,17	Art. 7º, Inciso IV	8,63%	20,00%	20,00%
BTG Pactual - Letra Financeira - Prazo 05 Anos - LF0022009R0	AT.FIN. RF - LF	34.439.552,15	0,75%												
Itau Unibanco - Letra Financeira - Prazo 02 Anos - LF PRE	AT.FIN. RF - LF	112.235.531,10	2,43%												
Santander - Letra Financeira - Prazo 02 Anos - LF IPCA	AT.FIN. RF - LF	54.777.979,91	1,19%												
BTG Pactual - Letra Financeira - Prazo 05 Anos - LF002200P19	AT.FIN. RF - LF	162.854.175,22	3,52%												
Bradesco FI em Ações Dividendos	IDIV	50.404.701,18	1,09%	566.825.917,03	8,89%	218.210.063,67	Art. 8º, Inciso I	4,72%	40,00%	40,00%					
AZ Quest Small Mid Caps FIC de FIA	SMML MID	58.606.264,22	1,27%	786.555.266,23	7,45%										
Icatu Vanguarda Dividendos Fundo de Investimento em Ações	IDIV	22.575.314,98	0,49%	679.763.788,40	3,32%										
Tarpon GT 30 FIC De FIA	AÇÕES LIVRE	44.821.576,08	0,97%	680.339.527,08	6,59%										
BTG Pactual Absoluto Institucional FIQ FIA	AÇÕES LIVRE	41.802.207,21	0,90%	1.350.305.370,46	3,10%										
Rio Bravo Proteção II Fundo de Investimento Multimercado	MULTIMERC	20.969.827,23	0,45%	164.644.510,49	12,74%										
Patira Special Opportunities I - FIQ FIP	FIP	31.657,68	0,00%	2.599.271,66	1,22%										
Patira Brasil Infraestrutura III FIQ FIP	FIP	2.666.227,52	0,06%	134.480.693,27	1,98%										
BTG Pactual Timberland Fund I - FIQ de FIP	FIP	3.960.266,85	0,09%	96.472.100,61	4,11%										
Kinea Private Equity IV Feeder Institucional I FIP Multiestatégia	FIP	66.973.293,82	1,45%	1.764.134.847,25	3,80%										
FIP Multiestatégia Kinea Private Equity II	FIP	1.912.407,08	0,04%	153.854.764,04	1,24%										
BTG Pactual Economia Real II FIP - Multiestatégia	FIP	8.655.203,04	0,19%	61.989.720,05	13,96%										
TOTAL SALDOS CONTAS COR. + VALORES EM TRANS.	DISPONIB CC + VT	169.624,33	0,00%			169.624,33	Disponib. C/C + V.T.	0,00%	0,00%	0,00%					
TOTAIS DO PLANO FINANCEIRO		4.622.047.600,81	100,00%			4.622.047.600,81		100,00%							





ESTRATÉGIA DOS PRODUTOS DE INVESTIMENTOS DO PLANO FINANCEIRO		
RENDIA FIXA	VALOR - R\$	PARTIC. - %
TPF MARCAÇÃO A MERCADO	444.795.445,52	9,62%
TPF MARCAÇÃO NA CURVA	1.670.619.236,01	36,14%
IMA-B	92.075.825,21	1,99%
CDI	1.546.025.148,49	33,45%
ALOCAÇÃO	56.561.901,49	1,22%
CRÉDITO PRIVADO	89.660.832,70	1,94%
ATIVO FINANC. RF - LETRA FINANCEIRA	398.760.640,17	8,63%
TOTAL RENDA FIXA	4.298.499.029,59	93,00%
RENDIA VARIÁVEL	VALOR - R\$	PARTIC. - %
IDIV	72.980.016,16	1,58%
SMLL MID	58.606.264,22	1,27%
AÇÕES LIVRE, AÇÕES VALOR	86.623.783,29	1,87%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	218.210.063,67	4,72%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	VALOR - R\$	PARTIC. - %
FIP	84.199.055,99	1,82%
MM	20.969.827,23	0,45%
TOTAL INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	105.168.883,22	2,28%
DISPONIBIL. CONTA CORRENTE + VALORES EM TRÂNSITO	VALOR - R\$	PARTIC. - %
Saldo Contas Correntes + V.T.	169.624,33	0,00%
TOTAL GERAL	4.622.047.600,81	100,00%





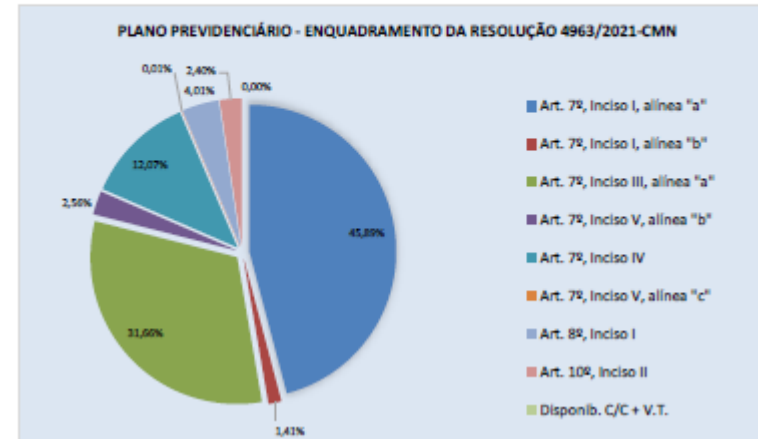
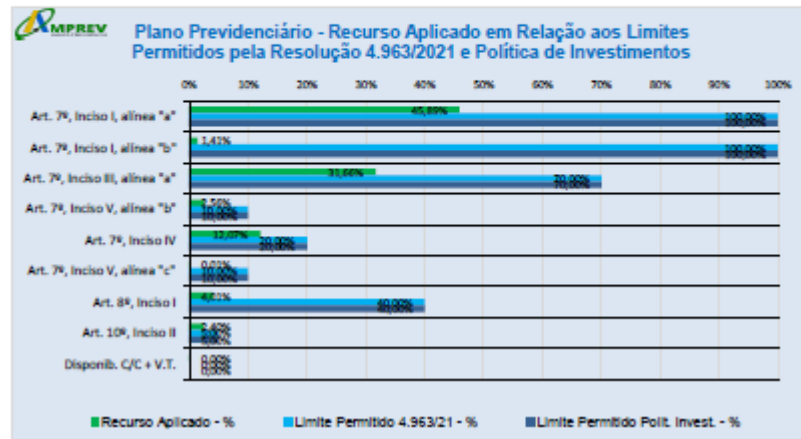
AMAPÁ PREVIDÊNCIA - AMPREV
DIRETORIA FINANCEIRA E ATUARIAL - DIFAT
DIVISÃO DE INVESTIMENTOS E MERCADO - DIM

**DEMONSTRATIVO DE CONSOLIDAÇÃO DOS ATIVOS DA CARTEIRA
DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO E ENQUADRAMENTO LEGAL
POSIÇÃO: MAIO/2023 - EM 31/05/2023**

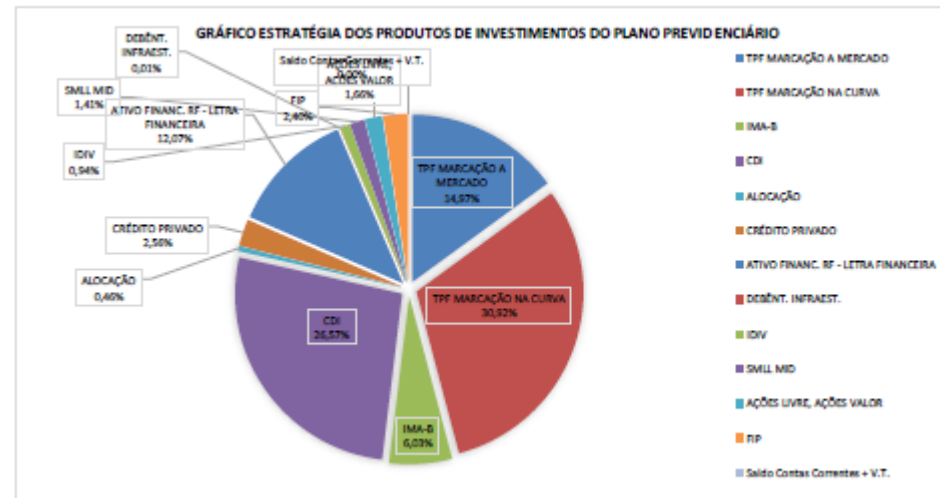
PLANO PREVIDENCIÁRIO - DEMONSTRATIVO DE ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS DA CARTEIRA										
ENQUADRAMENTO LEGAL DA CARTEIRA DA AMPREV - LIMITES DA RESOLUÇÃO 4.963/2021-CMN com Vinculação à Nota Técnica SEI Nº 12/2017-CGACI/SRPPS/SPREV/MF E POLÍTICA DE INVESTIMENTOS										
POSIÇÕES DA CARTEIRA				ENQUADRAMENTOS 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 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 - "M.MERC."	343.887.678,07	14,97%			1.054.344.667,90	Art. 7º, Inciso I, alínea "a"	45,89%	100,00%	100,00%
Carteira Admin. de TPF na Curva-Custódia Banco BTG Pactual-PP	TPF - "M.CURVA"	710.456.689,83	30,92%							
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	IMA-B	7.540.492,09	0,33%	447.876.024,07	1,68%	32.290.269,29	Art. 7º, Inciso I, alínea "b"	1,41%	100,00%	100,00%
Safra Soberano Regime Próprio FIC de FI RF Referenciado DI	CDI	24.758.777,20	1,08%	5.158.691.701,67	0,48%					
FIC FI Caixa Novo Brasil Renda Fixa Referenciado IMA-B LP	IMA-B	114.627.973,87	4,99%	1.265.571.591,84	9,06%					
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	IMA-B	16.370.268,46	0,71%	351.371.380,62	4,66%					
FI Caixa Brasil RF Referenciado DI Longo Prazo	CDI	147.830.543,61	6,43%	15.982.419.153,18	0,92%					
BB Previdenciário Fluxo Renda Fixa Simples FIC FI	CDI	95.343.853,00	4,15%	3.860.323.166,27	2,47%					
Itaú Institucional Alocação Dinâmica Renda Fixa FIC FI	ALOCACÃO	10.656.858,34	0,46%	2.062.404.983,41	0,52%					
BTG Pactual Tesouro Selic FI RF Referenciado DI	CDI	21.769.098,35	0,95%	13.081.140.366,94	0,17%	727.334.646,40	Art. 7º, Inciso III, alínea "a"	31,66%	70,00%	70,00%
Itaú Soberano Renda Fixa Simples LP FICFI	CDI	131.539.642,66	5,72%	40.509.656.994,14	0,32%					
BB Previdenciário Renda Fixa Referenciado DI LP Perfil FIC FI	CDI	140.626.384,17	6,12%	15.420.425.695,62	0,91%					
Bradesco FI RF Referenciado DI Federal Extra	CDI	34.920.700,57	1,52%	10.734.056.017,35	0,33%					
Santander RF Referenciado DI Institucional Premium FIC FI	CDI	13.649.323,37	0,59%	3.184.616.150,75	0,43%					
BB Previdenciário Renda Fixa Crédito Privado IPCA III FI	CRÉDITO PRIVADO	13.002.641,36	0,57%	321.142.550,57	4,05%	58.775.184,36	Art. 7º, Inciso V, alínea "b"	2,56%	10,00%	10,00%
BTG Pactual Crédito Corporativo I FIC de FI de RF Cred. Priv. LP	CRÉDITO PRIVADO	45.772.643,00	1,99%	2.375.453.512,69	1,93%					
BTG Pactual - Letra Financeira - Prazo 05 Anos - LF0022009QZ	AT.FIN. RF - LF	17.219.776,07	0,75%							
Bradesco - Letra Financeira - Prazo 05 Anos - LF0022009M4	AT.FIN. RF - LF	17.226.700,89	0,75%							
BTG Pactual - Letra Financeira - Prazo 05 Anos - LF00220087Z	AT.FIN. RF - LF	25.190.922,47	1,10%			277.326.632,06	Art. 7º, Inciso IV	12,07%	20,00%	20,00%
Bradesco - Letra Financeira - Prazo 05 Anos - LF002200JED	AT.FIN. RF - LF	27.463.806,43	1,20%							
Santander - Letra Financeira - Prazo 02 Anos - LF IPCA - PP	AT.FIN. RF - LF	27.371.250,98	1,19%							
Bradesco - Letra Financeira - Prazo 05 Anos - LF002200JED	AT.FIN. RF - LF	162.854.175,22	7,09%							
BTG Pactual Infra-B Fundo Incentivado de Investim. Infraest. RF	DEBENT. INFRAEST.	218.668,71	0,01%	4.373.373,42	5,00%	218.668,71	Art. 7º, Inciso V, alínea "c"	0,01%	10,00%	10,00%
Bradesco FI em Ações Dividendos	IDIV	8.826.400,18	0,38%	566.825.917,03	1,56%					
AZ Quest Small Mid Caps FIC de FIA	SMML MID	32.356.759,44	1,41%	786.656.266,23	4,11%					
Icatu Vanguarda Dividendos Fundo de Investimento em Ações	IDIV	12.762.645,51	0,56%	679.763.788,40	1,88%					
BB Ações Valor FIC de FI em Ações	AÇÕES VALOR	6.851.057,53	0,30%	811.651.815,24	0,84%	92.175.593,73	Art. 8º, Inciso I	4,01%	40,00%	40,00%
Vinci Mosaic Fundo de Investimento de Ações	AÇÕES LIVRE	17.687.655,44	0,77%	695.083.897,49	2,54%					
Tarpon GT 30 FIC De FIA	AÇÕES LIVRE	13.691.075,63	0,60%	680.339.527,08	2,01%					
BTG Pactual Economia Real FIP Multiestratégia	FIP	41.070.099,99	1,79%	2.954.332.542,30	1,39%	55.178.805,59	Art. 10º, Inciso II	2,40%	5,00%	5,00%
Kinea Private Equity V Feeder Institucional I FIP Multiestratégia	FIP	14.108.705,60	0,61%	443.015.303,89	3,18%					
TOTAL SALDOS CONTAS COR. + VALORES EM TRANS.	DISPONIB CC + VT	1.122,38	0,00%			1.122,38	Disponib. C/C + V.T.	0,00%	0,00%	0,00%
TOTAIS DO PLANO PREVIDENCIÁRIO		2.297.654.490,42	100,00%			2.297.654.490,42		100,00%		



PLANO PREVIDENCIÁRIO - GRÁFICOS DE DEMONSTRAÇÃO DE ENQUADRAMENTO LEGAL E ESTRATÉGIAS



ESTRATÉGIA DOS PRODUTOS DE INVESTIMENTOS DO PLANO PREVIDENCIÁRIO		
RENDA FIXA		
TPF MARCAÇÃO A MERCADO	343.887.878,07	14,97%
TPF MARCAÇÃO NA CURVA	710.458.889,83	30,92%
IMA-B	138.538.734,42	6,03%
CDI	610.438.322,93	26,57%
ALOCÇÃO	10.858.858,34	0,46%
CRÉDITO PRIVADO	58.775.194,38	2,56%
ATIVO FINANC. RF - LETRA FINANCEIRA	277.328.852,08	12,07%
DEBENT. INFRAEST.	218.888,71	0,01%
TOTAL RENDA FIXA	2.150.288.969,72	93,59%
RENDA VARIÁVEL		
IDIV	21.580.045,89	0,94%
SMLL MID	32.358.759,44	1,41%
AÇÕES LIVRE, AÇÕES VALOR	38.220.769,80	1,66%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	92.175.565,13	4,01%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		
FIP	55.178.865,59	2,40%
TOTAL INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	55.178.865,59	2,40%
DISPONIBIL. CONTA CORRENTE + VALORES EM TRÂNSITO		
Saldo Contas Correntes + V.T.	1.122,38	0,00%
TOTAL GERAL	2.297.854.490,42	100,00%



MAIO DE 2023						
PLANO FINANCEIRO						
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%
CARTEIRAS ADMIN. TIT. PÚB. FEDERAIS - A MERCADO	432.084.948,14	74.172.326,31	74.374.985,50	12.913.156,57	444.795.445,52	2,989971
CARTEIRAS ADMIN. TIT. PÚB. FEDERAIS - NA CURVA	1.668.366.712,97	0,00	13.955.716,49	18.208.239,53	1.670.619.236,01	1,101920
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.749.006.393,88	58.407.668,61	45.297.368,74	22.207.014,14	1.784.323.707,89	1,260247
ATIVOS FINANCEIRO DE R.F. EMITIDOS POR INST. FINANC.	394.000.447,71	0,00	0,00	4.780.192,46	398.780.640,17	1,208169
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	205.380.874,61	0,00	0,00	12.829.189,06	218.210.063,67	6,246535
FUNDOS DE INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	101.976.607,00	8.761.352,08	6.133.073,57	563.997,71	105.168.883,22	0,539170
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR						0,000000
TOTAIS - PLANO FINANCEIRO	4.548.815.984,31	141.341.347,00	139.761.144,30	71.481.789,47	4.621.877.976,48	1,570892
PLANO PREVIDENCIÁRIO						
SEGMENTO	SALDO ANTER. R\$	APLICAÇÃO - R\$	RESGATE - R\$	RENDIM. LIQ. - R\$	POSIÇÃO FINAL-R\$	RENTABILIDADE-%
CARTEIRAS ADMIN. TIT. PÚB. FEDERAIS - A MERCADO	341.579.796,31	685.399.730,66	685.412.127,68	2.330.278,78	343.887.678,07	0,682251
CARTEIRAS ADMIN. TIT. PÚB. FEDERAIS - NA CURVA	713.375.779,37	0,00	10.580.814,22	7.661.924,68	710.456.889,83	1,090208
FUNDOS DE RENDA FIXA	787.319.662,05	27.427.756,88	7.382.892,69	11.263.242,52	818.627.768,76	1,395063
ATIVOS FINANCEIRO DE R.F. EMITIDOS POR INST. FINANC.	273.955.389,33	0,00	0,00	3.371.242,73	277.326.632,06	1,230581
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	87.314.113,86	0,00	0,00	4.861.479,87	92.175.593,73	5,567805
FUNDOS DE INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	50.117.341,44	5.279.575,00	0,00	-218.110,85	55.178.805,59	-0,393724
FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR						0,000000
TOTAIS - PLANO PREVIDENC.	2.253.662.082,36	718.097.062,54	703.375.834,59	29.270.057,73	2.297.653.368,04	1,290349
CARTEIRA TOTAL - PF + PP	6.802.478.066,67	859.438.409,54	843.136.978,89	100.751.847,20	6.919.531.344,52	1,477564

144

Elaboração finalizada pela DIM em 15/06/2023. (Retificado em 16/08/2023)

43





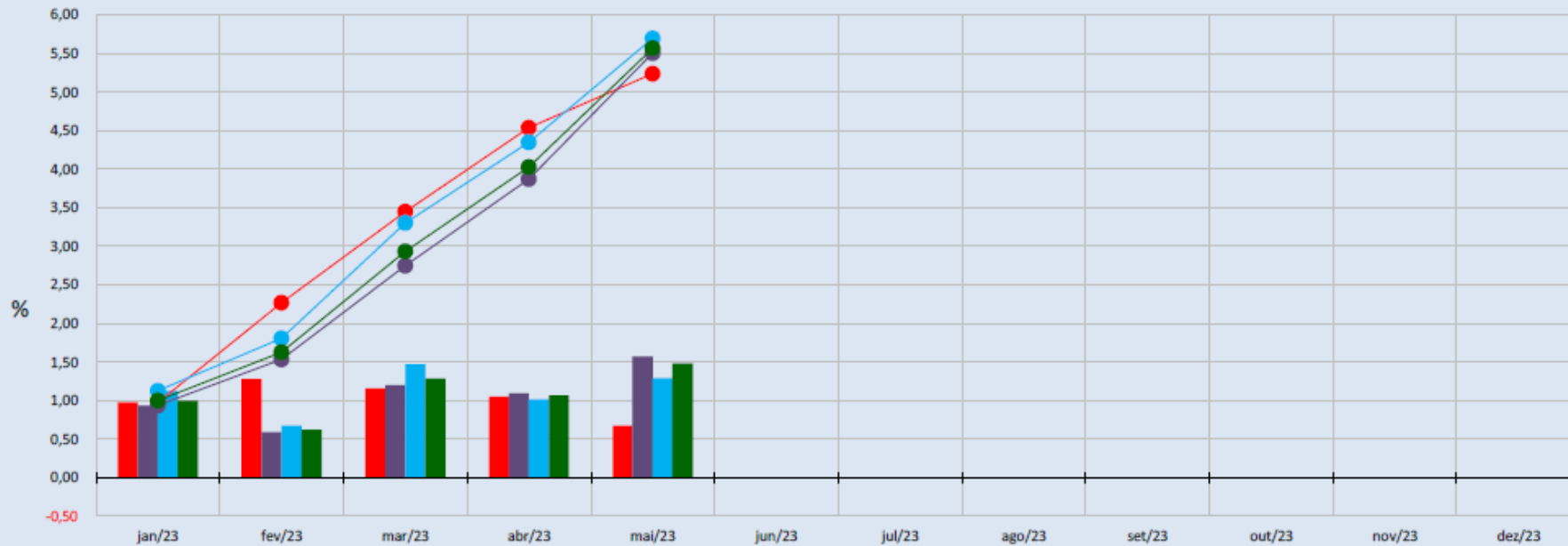
AMAPÁ PREVIDÊNCIA - AMPREV
 DIRETORIA FINANCEIRA E ATUARIAL - DIFAT
 DIVISÃO DE INVESTIMENTOS E MERCADO - DIM

DEMONSTRATIVOS DE RENTABILIDADES DA CARTEIRA DA AMPREV - Somente Aplicações

RENTABILIDADE ACUMULADA DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV E DA META DE RENTABILIDADE EM 2023 - (%)								
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/22		11,51235		6,307508		6,953631		6,497920
jan/23	0,972367	0,972367	0,936814	0,936814	1,126600	1,126600	0,998518	0,998518
fev/23	1,282400	2,267236	0,592175	1,534537	0,672464	1,806639	0,618424	1,623117
mar/23	1,152442	3,445806	1,196311	2,749206	1,468121	3,301284	1,286048	2,930038
abr/23	1,052423	4,534494	1,092468	3,871708	1,013325	4,348061	1,066234	4,027514
mai/23	0,672333	5,237314	1,570892	5,503420	1,290349	5,694515	1,477564	5,564587
jun/23								
jul/23								
ago/23								
set/23								
out/23								
nov/23								
dez/23								
Acumulado	5,237314		5,503420		5,694515		5,564587	



GRÁFICO DE RENTABILIDADE - NO MÊS E ACUMULADO EM 2023
CARTEIRA DE INVESTIMENTOS EM COMPARAÇÃO COM A META DE RENTABILIDADE DE IPCA (+) 5,44% a.a.



NO MÊS

META DE RENTABILIDADE
IPCA (+) 5,44% a.a.
no Mês - %

Rentabilidade do
Plano Financeiro
no Mês - %

Rentabilidade do
Plano Previdenciário
no Mês - %

Rentabilidade do
Financeiro (+)
Previdenciário
no Mês - %

NO ANO

META DE RENTABILIDADE
IPCA (+) 5,44% a.a.
no Ano - %

Rentabilidade do
Plano Financeiro
no Ano - %

Rentabilidade do
Plano Previdenciário
no Ano - %

Rentabilidade do
Financeiro (+)
Previdenciário
no Ano - %



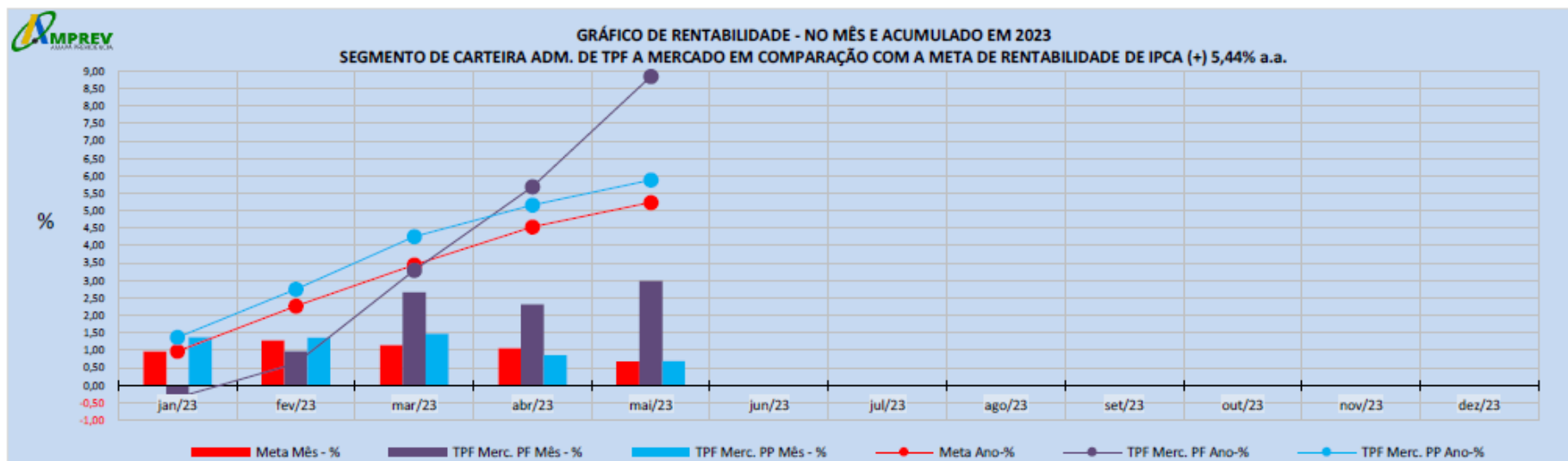
RENDIMENTO (R\$) EM COMPARAÇÃO COM O VALOR DA META DE RENTABILIDADE - R\$				
PLANO FINANCEIRO				
MÊS	Rendimento do Plano Financeiro - R\$	Meta de Rentabilidade IPCA (+) 5,44% a.a. no Mês - Em R\$	Rendimento do Plano (-) Valor da Meta de Rentabilidade - R\$	Rentabilidade Relativa em Relação a Meta de Rentabilidade - %
jan-23	40.567.562,09	42.107.131,05	-1.539.568,96	96,34
fev-23	26.065.714,77	56.447.232,36	-30.381.517,59	46,18
mar-23	53.034.498,07	51.089.676,65	1.944.821,42	103,81
abr-23	49.157.332,36	47.355.462,87	1.801.869,49	103,80
mai-23	71.481.789,47	30.593.827,53	40.887.961,94	233,65
jun-23				
jul-23				
ago-23				
set-23				
out-23				
nov-23				
dez-23				
ACUMULADO NO ANO	240.306.896,76	227.593.330,45	12.713.566,31	105,08

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-23	23.502.716,79	20.285.166,97	3.217.549,82	115,86
fev-23	14.377.385,48	27.417.916,14	-13.040.530,66	52,44
mar-23	32.077.397,29	25.180.034,99	6.897.362,30	127,39
abr-23	22.607.833,64	23.480.138,12	-872.304,48	96,28
mai-23	29.270.057,73	15.251.095,71	14.018.962,02	191,92
jun-23				
jul-23				
ago-23				
set-23				
out-23				
nov-23				
dez-23				
Acumulado	121.835.390,93	111.614.351,94	10.221.038,99	108,73

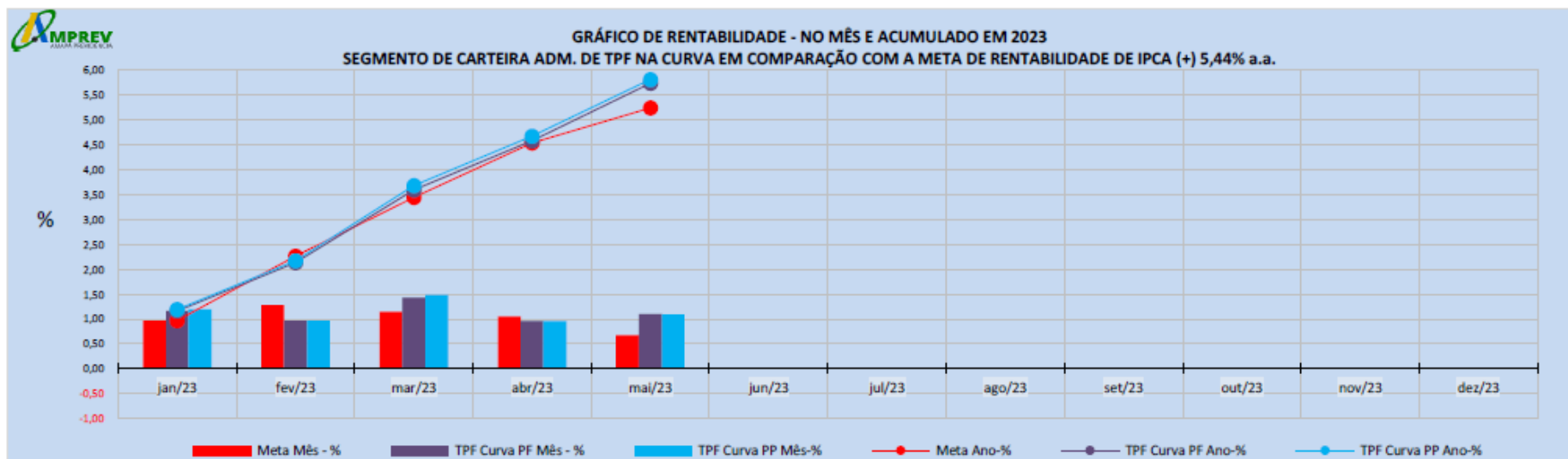
RENDIMENTO (R\$) EM COMPARAÇÃO COM O VALOR DA META DE RENTABILIDADE - R\$				
CARTEIRA CONSOLIDADA - PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO				
MÊS	Rendimento da Carteira Consolidada PF (+) PP - R\$	Meta de Rentabilidade IPCA (+) 5,44% a.a. no Mês - Em R\$	Rendimen. dos Planos (-) Valor da Meta de Rentabilidade - R\$	Rentabilidade Relativa em Relação a Meta de Rentabilidade - %
jan-23	64.070.278,88	62.392.298,02	1.677.980,86	102,69
fev-23	40.443.100,25	83.865.148,51	-43.422.048,26	48,22
mar-23	85.111.895,36	76.269.711,64	8.842.183,72	111,59
abr-23	71.765.166,00	70.835.600,99	929.565,01	101,31
mai-23	100.751.847,20	45.844.923,24	54.906.923,96	219,77
jun-23				
jul-23				
ago-23				
set-23				
out-23				
nov-23				
dez-23				
Acumulado	362.142.287,69	339.207.682,39	22.934.605,30	106,25



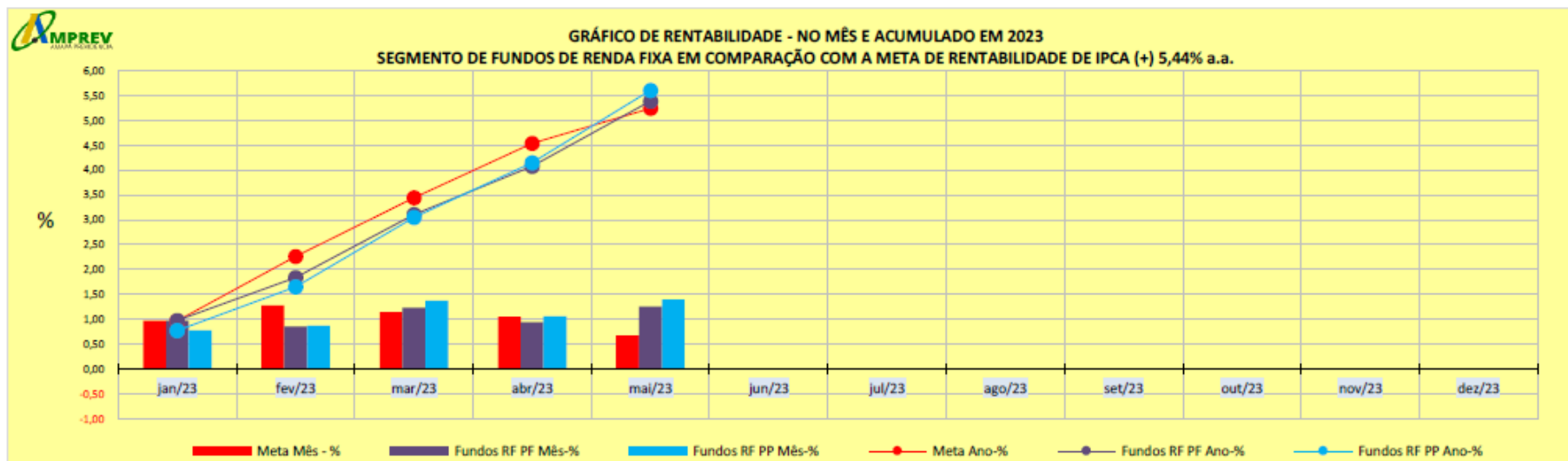
RENTABILIDADE ACUMULADA DO SEGMENTO DE CART. ADMIN. DE TPF A MERCADO Vs META DE RENTABILIDADE EM 2023 - (%)						
MÊS	META DE RENTABIL. - IPCA + 5,44% a.a.		DO PLANO FINANCEIRO		DO PLANO PREVIDENCIÁRIO	
	Meta Mês - %	Meta Ano-%	TPF Merc. PF Mês - %	TPF Merc. PF Ano-%	TPF Merc. PP Mês - %	TPF Merc. PP Ano-%
jan/23	0,972367	0,972367	-0,353032	-0,353032	1,368622	1,368622
fev/23	1,282400	2,267236	0,977511	0,621029	1,359033	2,746255
mar/23	1,152442	3,445806	2,658766	3,296306	1,475444	4,262218
abr/23	1,052423	4,534494	2,313080	5,685632	0,861479	5,160416
mai/23	0,672333	5,237314	2,989971	8,845602	0,682251	5,877874
jun/23						
jul/23						
ago/23						
set/23						
out/23						
nov/23						
dez/23						
Acumulado	5,237314		8,845602		5,877874	



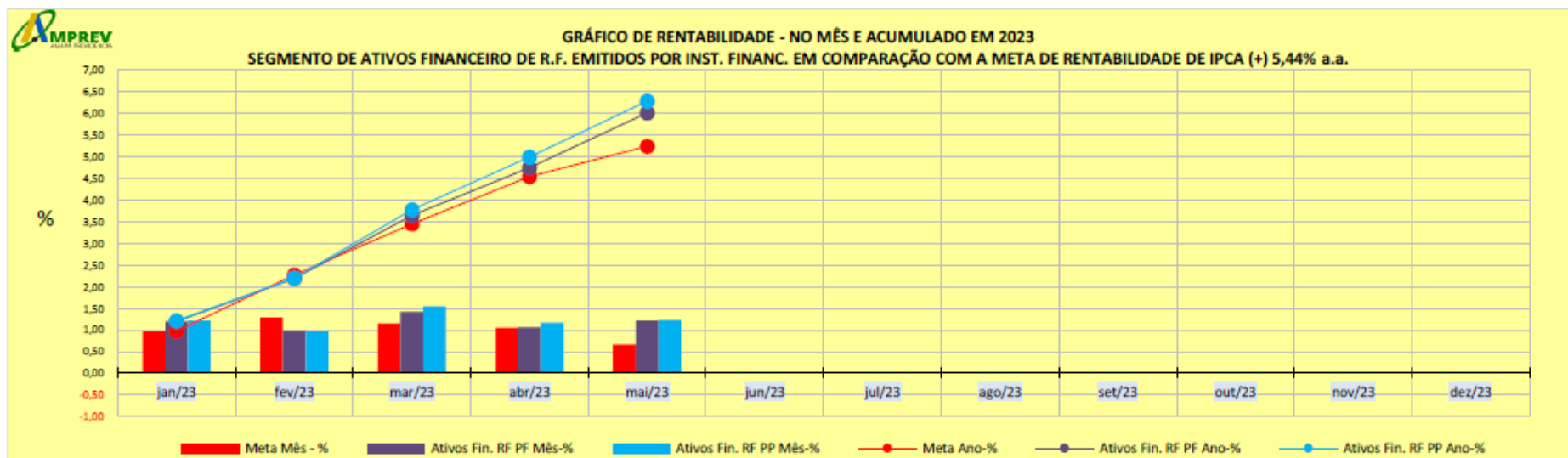
RENTABILIDADE ACUMULADA DO SEGMENTO DE CART. ADMIN. DE TPF NA CURVA Vs META DE RENTABILIDADE EM 2023 - (%)						
MÊS	META DE RENTABIL. - IPCA + 5,44% a.a.		DO PLANO FINANCEIRO		DO PLANO PREVIDENCIÁRIO	
	Meta Mês - %	Meta Ano-%	TPF Curva PF Mês - %	TPF Curva PF Ano-%	TPF Curva PP Mês-%	TPF Curva PP Ano-%
jan/23	0,972367	0,972367	1,162693	1,162693	1,193196	1,193196
fev/23	1,282400	2,267236	0,959725	2,133577	0,962618	2,167300
mar/23	1,152442	3,445806	1,427389	3,591421	1,478495	3,677839
abr/23	1,052423	4,534494	0,954024	4,579708	0,955209	4,668179
mai/23	0,672333	5,237314	1,101920	5,732092	1,090208	5,809279
jun/23						
jul/23						
ago/23						
set/23						
out/23						
nov/23						
dez/23						
Acumulado	5,237314		5,732092		5,809279	



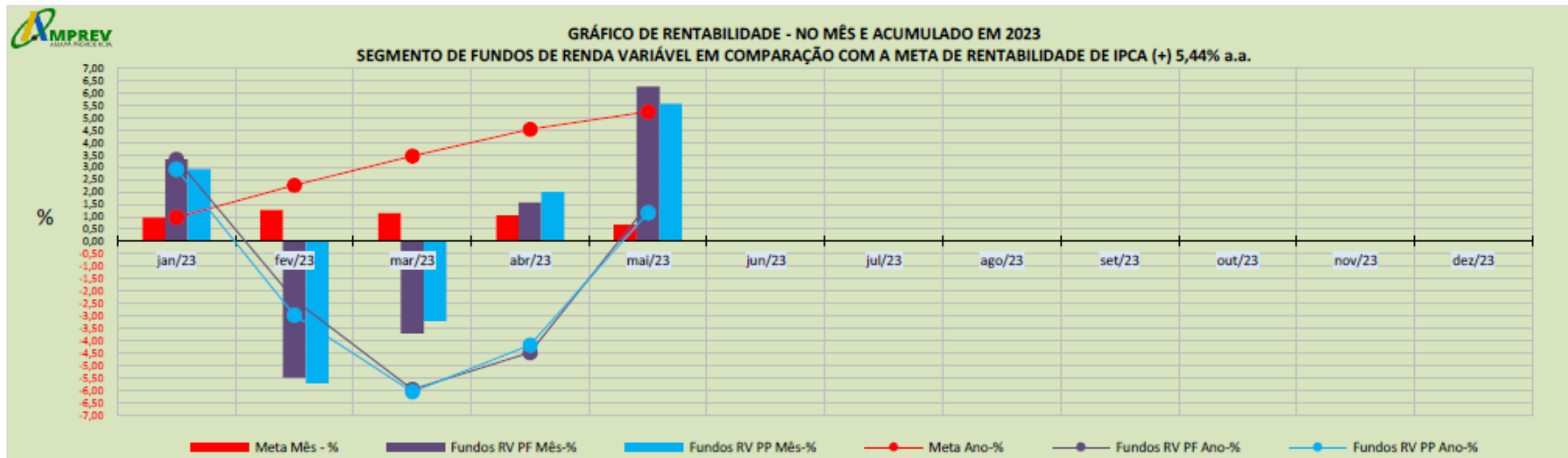
RENTABILIDADE ACUMULADA DO SEGMENTO DE FUNDOS DE RENDA FIXA Vs META DE RENTABILIDADE EM 2023 - (%)						
MÊS	META DE RENTABIL. - IPCA + 5,44% a.a.		DO PLANO FINANCEIRO		DO PLANO PREVIDENCIÁRIO	
	Meta Mês - %	Meta Ano-%	Fundos RF PF Mês-%	Fundos RF PF Ano-%	Fundos RF PP Mês-%	Fundos RF PP Ano-%
jan/23	0,972367	0,972367	0,979840	0,979840	0,776042	0,776042
fev/23	1,282400	2,267236	0,853321	1,841522	0,871296	1,654100
mar/23	1,152442	3,445806	1,239322	3,103667	1,371439	3,048224
abr/23	1,052423	4,534494	0,938980	4,071789	1,065291	4,145988
mai/23	0,672333	5,237314	1,260247	5,383350	1,395063	5,598890
jun/23						
jul/23						
ago/23						
set/23						
out/23						
nov/23						
dez/23						
Acumulado	5,237314		5,383350		5,598890	



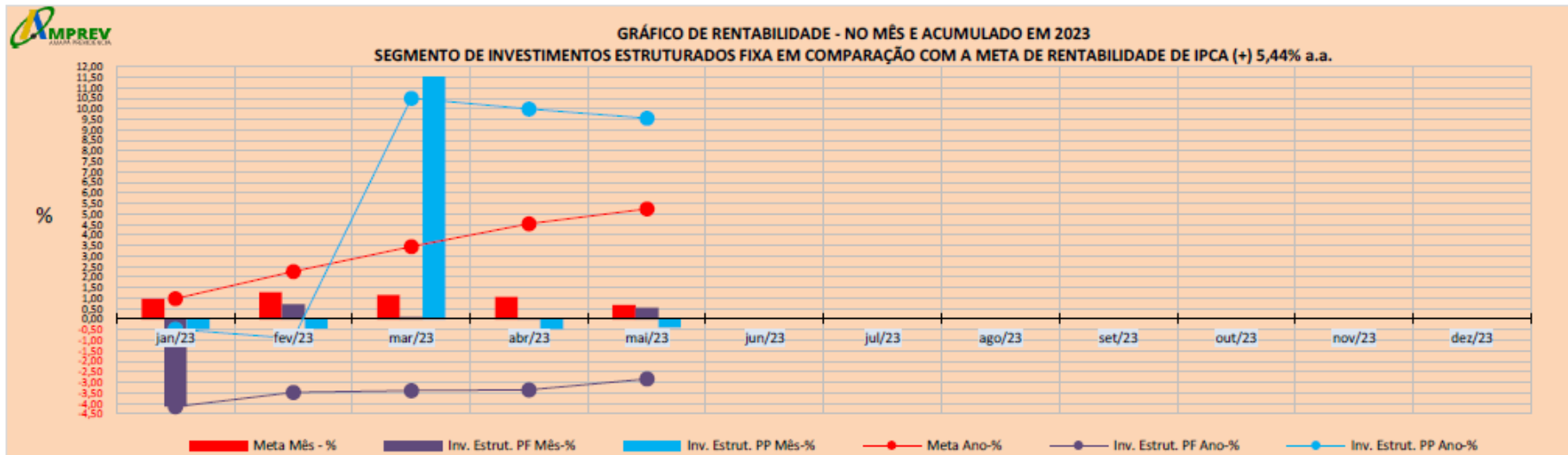
RENTABILIDADE ACUMULADA DO SEGMENTO DE ATIVOS FINANC. DE R.F. EMITIDOS POR INST. FINANC. Vs META DE RENTABILIDADE EM 2023 - (%)						
MÊS	META DE RENTABIL. - IPCA + 5,44% a.a.		DO PLANO FINANCEIRO		DO PLANO PREVIDENCIÁRIO	
	Meta Mês - %	Meta Ano-%	Ativos Fin. RF PF Mês-%	Ativos Fin. RF PF Ano-%	Ativos Fin. RF PP Mês-%	Ativos Fin. RF PP Ano-%
jan/23	0,972367	0,972367	1,194246	1,194246	1,212290	1,212290
fev/23	1,282400	2,267236	0,984306	2,190308	0,971063	2,195125
mar/23	1,152442	3,445806	1,418096	3,639464	1,546517	3,775590
abr/23	1,052423	4,534494	1,063691	4,741868	1,167433	4,987101
mai/23	0,672333	5,237314	1,208169	6,007327	1,230581	6,279052
jun/23						
jul/23						
ago/23						
set/23						
out/23						
nov/23						
dez/23						
Acumulado	5,237314		6,007327		6,279052	



RENTABILIDADE ACUMULADA DO SEGMENTO DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL Vs META DE RENTABILIDADE EM 2023 - (%)						
MÊS	META DE RENTABIL. - IPCA + 5,44% a.a.		DO PLANO FINANCEIRO		DO PLANO PREVIDENCIÁRIO	
	Meta Mês - %	Meta Ano-%	Fundos RV PF Mês-%	Fundos RV PF Ano-%	Fundos RV PP Mês-%	Fundos RV PP Ano-%
jan/23	0,972367	0,972367	3,328580	3,328580	2,912773	2,912773
fev/23	1,282400	2,267236	-5,489708	-2,343858	-5,704105	-2,957479
mar/23	1,152442	3,445806	-3,696944	-5,954150	-3,187129	-6,050349
abr/23	1,052423	4,534494	1,574611	-4,473294	2,005305	-4,166372
mai/23	0,672333	5,237314	6,246535	1,493816	5,567805	1,169458
jun/23						
jul/23						
ago/23						
set/23						
out/23						
nov/23						
dez/23						
Acumulado	5,237314		1,493816		1,169458	



RENTABILIDADE ACUMULADA DO SEGMENTO DE INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS Vs META DE RENTABILIDADE EM 2023 - (%)						
MÊS	META DE RENTABIL. - IPCA + 5,44% a.a.		DO PLANO FINANCEIRO		DO PLANO PREVIDENCIÁRIO	
	Meta Mês - %	Meta Ano-%	Inv. Estrut. PF Mês-%	Inv. Estrut. PF Ano-%	Inv. Estrut. PP Mês-%	Inv. Estrut. PP Ano-%
jan/23	0,972367	0,972367	-4,160918	-4,160918	-0,486269	-0,486269
fev/23	1,282400	2,267236	0,703223	-3,486956	-0,436293	-0,920440
mar/23	1,152442	3,445806	0,086427	-3,403542	11,522817	10,496316
abr/23	1,052423	4,534494	0,040036	-3,364869	-0,468884	9,978216
mai/23	0,672333	5,237314	0,539170	-2,843842	-0,393724	9,545206
jun/23						
jul/23						
ago/23						
set/23						
out/23						
nov/23						
dez/23						
Acumulado	5,237314		-2,843842		9,545206	



Recomendações

Tendo em conta **não constar** nesses autos digitais algumas informações, cumpre, para fins de registros, controle, aprimoramento e aperfeiçoamento dos atos de gestão, recomendar:

1) Que a unidade gestora implemente processo de controle de qualidade e documentação, revisão e requisitos de auditoria rigorosos no que se refere às decisões na aplicação dos recursos, nos termos do art. 88, §2º, da Portaria nº 1.467/2022;

2) Que a unidade gestora reavalie e aprimore o sistema de controle interno, com procedimentos apropriados para os riscos mais relevantes identificados na gestão e aplicação dos recursos do RPPS, nos termos art. 125 e 126, da Portaria nº 1.467/2022;

3) Que a unidade gestora visando a transparência das informações sobre investimentos, mantenha registro por meio digital de todos os documentos que suportem a tomada de decisão na aplicação de recursos, nos termos dos artigos 148 e 149, da Portaria nº 1.467/2022, e

4) Que a unidade gestora, através de suas unidades competente, **acoste tempestivamente**, em autos digitais uno todos os documentos (relatórios, extratos), manifestações, recomendações, decisões e deliberações, de modo a permitir maior controle social, em especial:

1) o **RELATÓRIO** detalhado com informações sobre rentabilidade, os riscos das diversas modalidades de operações realizadas nas aplicações do regime e aderência à política de investimentos (cf. art. 136, Portaria n. 1.467/22);

2) os **EXTRATOS FINANCEIROS DAS APLICAÇÕES** (cf. art. 149, Portaria n. 1.467/22); e

3) **Manifestação do órgão de Controle Interno da Instituição (Divisão de Auditoria Interna)**, a exercer de modo contínuo o



monitoramento e a fiscalização dos processos de investimentos e sua aderência à Política de Investimentos em vigor (cf. atribuições conforme **Ato Normativo nº 005/2023-DIEX/AMPREV – Manual de Atribuições da Amprev, c/c art. 125 e art. 126, Portaria n. 1.467/22**).

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 procedimentos e encaminhamentos para aplicação dos recursos.

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 tendo em conta as recomendações acima referenciadas, **VOTO PELA CONFORMIDADE, COM RESSALVA, 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 maio de 2023.

Macapá-AP, 23 de fevereiro de 2024.

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 23/02/2024, sendo aprovado por unanimidade pelos demais membros do Conselho Fiscal da Amapá Previdência - COFISPREV, conforme abaixo.

Elionai Dias da Paixão - Conselheiro Titular/Presidente

Adriene Ribeiro Benjamin Pinheiro - Conselheira Titular

Arnaldo Santos Filhos - Conselheiro Titular

Francisco das Chagas Ferreira Feijó - Conselheiro Titular

Jurandil dos Santos Juarez - Conselheiro Titular

