

RELATÓRIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - JUNHO/2015

ALOCACAO DOS RECURSOS DIVERSIFICACAO	E G M E N T O	VALOR R\$	RENTABILIDADE DO FUNDO		EM RELACAO					
					META ATUARIAL		META GERENCIAL			
			NO MÊS	NO ANO 2015	INPC + 6%a.a. NO MÊS	NO ANO 2015	CDI NO MÊS	NO ANO 2015	IBOVESPA (Diferença) NO MÊS	NO ANO 2015

PLANO FINANCEIRO

BANCO DO BRASIL S/A										
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)	R.F.	14.626.289,83								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	714.678.640,25	-0,25	8,57	-20,05	86,40	-23,68	144,96		
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)	R.F.	219.304,23								
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	3.468.242,04	-0,29	8,21	-23,10	82,68	-27,29	138,71		
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	3.144.897,94	1,09	6,06	86,62	61,02	102,30	102,38		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	45.427.183,72	1,00	5,53	79,69	55,74	94,11	93,52		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA II	R.F.	18.902.511,16	0,92	8,17	73,47	82,29	86,77	138,07		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	9.239.701,64	0,25	7,14	20,03	71,96	23,66	120,73		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	17.963.005,77	0,31	4,47	24,82	45,01			-0,30	-1,68
Brasil Ações IBRX Indexado FIC FI	R.V.	7.889.628,30	0,56	3,66	44,23	36,90			-0,05	-2,48
BB Ações Consumo FIC FI	R.V.	4.471.966,62	2,11	6,17	167,88	62,19			1,50	0,03
BB Ações Cielo FI	R.V.	17.112.581,45	9,40	26,87	747,70	270,73			8,79	20,72
BB Ações BB Seguridade FI em Ações	R.V.	16.687.020,73	2,10	8,08	167,15	81,40			1,49	1,93
TOTAL		873.830.973,68								
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL										
FI Caixa Brasil IPCA XI Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	21.701.562,50	1,33	8,78	105,59	88,50	124,71	148,49		
FI Caixa Brasil IPCA XII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	21.902.900,00	1,35	8,86	107,39	89,28	126,83	149,79		
FI Caixa Brasil IPCA XIII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	21.256.800,00	1,20	8,80	95,17	88,62	112,39	148,69		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	16.007.331,92	1,07	5,95	85,08	59,97	100,48	100,61		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	94.676.563,19	-0,22	8,52	-17,54	85,82	-20,71	143,99		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	17.781.853,90	0,77	7,20	61,12	72,58	72,19	121,77		
FIDC da Companhia Estadual de Águas e Esgotos-CEDAE	R.F.	1.867.852,06	-3,27	-16,06	-259,94	-161,78	-307,00	-271,43		
FIDC Casan Saneamento	R.F.	20.173.890,39	0,09	-0,04	7,26	-0,42	8,57	-0,70		
Caixa Brasil IRF-M 1+ TP RF LP	R.F.	10.670.739,16	-0,07	4,69	-5,64	47,22	-6,66	79,23		
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	15.098.273,37	1,12	2,41	89,03	24,33			0,51	-3,73
Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS	R.V.	10.917.036,17	-0,37	0,05	-29,05	0,49			-0,97	-6,10
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	735.684,81	-0,07	-11,05	-5,89	-111,32			-0,68	-17,19
Caixa FI Ações Institucional BDR Nível I	R.V.	4.196.005,91	-4,23	15,94	-336,51	160,62			-4,84	9,79
FIP Caixa Integração e Logística	R.V.	54.548,66	-7,35	-32,10	-585,17	-323,48			-7,96	-38,25
FI Caixa Brasil IPCA V Multimercado Crédito Privado	M.M.	19.941.062,50	1,27	9,13	100,69	92,04	118,92	154,43		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	7.326.502,80	1,26	9,11	100,63	91,77	118,85	153,97		
FI Caixa Brasil IPCA VIII Multimercado Crédito Privado	M.M.	6.584.909,52	1,27	9,03	101,40	91,01	119,75	152,70		
TOTAL		290.893.516,86								
BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	201.222.417,05	-0,26	8,43	-21,09	84,91	-24,91	142,47		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	106.809.685,82	0,27	6,61	21,48	66,61	25,37	111,76		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	4.798.868,31	-0,78	8,92	-61,70	89,90	-72,87	150,83		
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.	12.726.008,84	-2,21	-9,20	-175,67	-92,68			-2,81	-15,34
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	2.135.835,19	0,23	4,81	17,95	48,42			-0,38	-1,34
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	974.747,88	1,71	0,25	135,98	2,55			1,10	-5,89
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	1.494.183,38	0,98	5,85	78,11	58,96	92,2	98,93		
TOTAL		330.161.746,47								
ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	103.144.153,87	-0,30	8,09	-23,92	81,51	-28,24	136,76		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	12.956.130,73	0,81	7,21	64,65	72,70	76,35	121,97		
Itaú Institucional RF PRE LP FIC FI	R.F.	4.869.480,09	0,29	4,92	23,03	49,60	27,20	83,22		
Itaú FOF RPI Ações Ibovespa Ativo - FIC FI	R.V.	37.948.291,98	0,64	3,42	50,85	34,46			0,03	-2,73
FIC FIP Kinea Private Equity II	R.V.	4.410.576,38	-0,48	-1,92	-38,53	-19,33			-1,09	-8,06
Itaú Ações Consumo FI	R.V.	4.536.737,60	1,96	6,56	155,63	66,14			1,35	0,42
Itaú Institucional Multimercado Juros e Moedas	M.M.	4.659.199,88	1,04	6,03	82,44	60,74	97,4	101,91		
TOTAL		172.524.570,53								
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A										
Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo	R.F.	14.232.242,05	-0,56	6,52	-44,45	65,65	-52,50	110,15		
Hsbc FI em Ações Ibovespa	R.V.	8.916.475,63	0,42	4,86	33,14	49,00			-0,19	-1,28
Hsbc FI Ações Ibovespa Valuation	R.V.	3.253.845,93	-0,47	0,95	-37,62	9,60			-1,08	-5,19
Hsbc FI de Ações Small Caps	R.V.	799.227,75	-0,19	2,95	-14,78	29,69			-0,79	-3,20
TOTAL		27.201.791,36								
BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	83.452.955,86	-0,29	8,30	-22,84	83,60	-26,97	140,26		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	1.274.013,58	-0,81	-4,32	-64,57	-43,51			-1,42	-10,46
TOTAL		84.726.969,44								
GW CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.										
GW Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	324.018,28	17,39	4,62	1.383,54	46,51			16,78	-1,53
TOTAL		324.018,28								
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.										
BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.068.097,78	0,14	3,77	11,10	37,96			-0,47	-2,38
TOTAL		2.068.097,78								
BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual Carteira Administrada	R.F.	104.041.336,06	0,77	5,46	61,04	55,01	72,10	92,30		
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	28.452.239,84	-0,35	7,93	-28,15	79,87	-33,24	134,00		
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	16.739.951,64	0,82	7,29	65,25	73,43	77,06	123,20		
BTG Pactual Master Cash FI Referenciado DI	R.F.	5.557.793,22	1,05	5,82	83,19	58,59	98,25	98,31		
BTG Pactual Dividendos FI de Ações	R.V.	28.057.057,66	1,99	10,49	158,49	105,68			1,38	4,34
BTG Pactual Absoluto Institucional FIQ de FI de Ações	R.V.	3.821.679,53	2,37	11,93	188,29	120,21			1,76	5,78
TOTAL		186.670.057,95								
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.										
Geração Futuro Dividendos FIA	R.V.	2.797.711,35	1,28	1,86	101,76	18,76			0,67	-4,28
TOTAL		2.797.711,35								

QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.										
Queluz Valor Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.764.470,90	-0,35	0,47	-27,75	4,72			-0,96	-5,68
TOTAL		1.764.470,90								
PATRIA INVESTIMENTOS LTDA.										
Patria Special Opportunities I - FIQ FIP	R.V.	5.158.853,25	-0,23	-2,70	-18,59	-27,16			-0,84	-8,84
P2 Brasil Infraestrutura III FIQ FIP	R.V.	434.596,66	13,71	10,27	1.091,44	103,43			13,11	4,12
TOTAL		5.593.449,91								
QUEST INVESTIMENTOS										
Quest Small Fiq Fia	R.V.	3.596.944,22	0,68	-5,83	54,14	-58,77			0,07	-11,98
TOTAL		3.596.944,22								
BRZ INVESTIMENTOS LTDA										
Terras Brasil - FIP	R.V.	4.938.538,99	-0,12	-0,74	-9,71	-7,43			-0,73	-6,88
TOTAL		4.938.538,99								
TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO		1.987.092.857,72	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/06/2015							

PLANO PREVIDENCIÁRIO										
CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	212.039.595,81	0,56	7,52	44,23	75,80	52,24	127,17		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	96.861.325,14	-0,22	8,52	-17,54	85,82	-20,71	143,99		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	4.912.957,64	0,77	7,20	61,12	72,58	72,19	121,77		
FI Caixa Brasil IPCA XV Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	7.119.386,07	1,25	8,82	99,54	88,86	117,56	149,09		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	11.407.930,26	1,07	5,95	85,08	59,97	100,48	100,61		
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	394.363,84	-0,07	-11,05	-5,89	-111,32			-0,68	-17,19
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	7.030.673,80	1,26	9,11	100,63	91,77	118,85	153,97		
TOTAL		339.766.232,56								
BANCO DO BRASIL S/A										
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	35.117.189,52	-0,29	8,21	-23,10	82,68	-27,29	138,71		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	7.542.153,03	1,00	5,53	79,69	55,74	94,11	93,52		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	5.575.987,68	0,25	7,14	20,03	71,96	23,66	120,73		
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	7.798.872,57	1,09	6,06	86,62	61,02	102,30	102,38		
BB Ações Cielo FI	R.V.	7.114.180,60	9,40	26,87	747,70	270,73			8,79	20,72
TOTAL		63.148.383,40								
GWI CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.										
GW Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	934.954,71	17,39	4,62	1.383,54	46,51			16,78	-1,53
TOTAL		934.954,71								
BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	17.813.416,15	0,82	7,29	65,25	73,43	77,06	123,20		
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	11.467.480,23	-0,35	7,93	-28,15	79,87	-33,24	134,00		
TOTAL		29.280.896,38								
BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	13.947.686,46	-0,26	8,43	-21,09	84,91	-24,91	142,47		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	6.183.032,78	0,27	6,61	21,48	66,61	25,37	111,76		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	13.032.603,30	-0,78	8,92	-61,70	89,90	-72,87	150,83		
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	737.623,14	0,23	4,81	17,95	48,42			-0,38	-1,34
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	520.582,36	1,71	0,25	135,98	2,55			1,10	-5,89
TOTAL		34.421.528,04								
ITAÚ UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	9.566.857,74	-0,30	8,09	-23,92	81,51	-28,24	136,76		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	4.880.311,70	0,81	7,21	64,65	72,70	76,35	121,97		
TOTAL		14.447.169,44								
BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	3.626.718,30	-0,29	8,30	-22,84	83,60	-26,97	140,26		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	588.927,58	-0,81	-4,32	-64,57	-43,51			-1,42	-10,46
TOTAL		4.215.645,88								
TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO		486.214.810,41	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/06/2015							

TOTAL GERAL APLICADO - (R\$)	2.473.307.668,13	PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO
-------------------------------------	-------------------------	--

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 30/06/2015			
PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	833.565.570,37	41,95%	-1.362.964,52
FUNDOS DE RENDA FIXA	888.457.948,10	44,71%	1.274.191,37
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	225.063.481,17	11,33%	2.848.642,67
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	40.005.858,08	2,01%	485.772,42
SALDO EM CONTAS CORRENTES	144.853,90	0,01%	
TOTALS	1.987.237.711,62	100,00%	3.245.641,94
PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	212.039.595,81	43,61%	1.059.313,46
FUNDOS DE RENDA FIXA	256.853.908,57	52,83%	153.043,32
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	10.290.632,23	2,12%	754.763,79
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	7.030.673,80	1,45%	87.790,84
SALDO EM CONTAS CORRENTES	8.960,36	0,00%	
TOTALS	486.223.770,77	100,00%	2.054.911,41

CONSOLIDAÇÃO DOS PLANOS NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - JUNHO DE 2015			
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	1.045.605.166,18	42,27%	-303.651,06
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.145.311.856,67	46,30%	1.427.234,69
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	235.354.113,40	9,52%	3.603.406,46
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	47.036.531,88	1,90%	573.563,26
SALDO EM CONTAS CORRENTES	153.814,26	0,01%	
TOTALS	2.473.461.482,39	100,00%	5.300.553,35

SIGLAS
R.F. - Renda Fixa
R.V. - Renda Variável
M.M. - Multimercado
CDI - Certificado de Depósito Interfinanceiro
IBOVESPA - Índice da Bolsa de Valores Est. São Paulo

DISPONIBILIDADE POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - JUNHO DE 2015					Qtde. de Aplicaç.	
INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	PF	PP
BANCO DO BRASIL S/A	936.979.357,08	11.713,33	936.991.070,41	37,88%	11	5
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	630.659.749,42	4.264,30	630.664.013,72	25,50%	17	7
BANCO BRADESCO S/A	364.583.274,51	0,00	364.583.274,51	14,74%	7	5
ITAU UNIBANCO S/A	186.971.739,97	133.832,05	187.105.572,02	7,56%	7	2
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	27.201.791,36	4.004,45	27.205.795,81	1,10%	4	
BANCO SANTANDER S/A	88.942.615,32	0,13	88.942.615,45	3,60%	2	2
GWÍ CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.	1.258.972,99	0,00	1.258.972,99	0,05%	1	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.068.097,78	0,00	2.068.097,78	0,08%	1	
BANCO BTG PACTUAL	215.950.954,33	0,00	215.950.954,33	8,73%	6	2
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.	2.797.711,35	0,00	2.797.711,35	0,11%	1	
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.	1.764.470,90	0,00	1.764.470,90	0,07%	1	
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA	5.593.449,91	0,00	5.593.449,91	0,23%	2	
QUEST SMALL FIQ FIA	3.596.944,22	0,00	3.596.944,22	0,15%	1	
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	4.938.538,99	0,00	4.938.538,99	0,20%	1	
TOTAIS	2.473.307.668,13	153.814,26	2.473.461.482,39	100,00%	62	24

Em junho de 2015, os índices para atingimento das metas, atuarial e gerencial, são os seguintes:

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	ÍNDICE	JUN/15	2015	ÍNDICE	JUN/15	2015
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,26	9,92	C.D.I.	1,06	5,92
RENTA FIXA	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,26	9,92	C.D.I.	1,06	5,92
RENTA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,26	9,92	IBOVESPA	0,61	6,15
RENTA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,26	9,92	C.D.I.	1,06	5,92

A Amapá Previdência, seguindo as diretrizes estabelecidas em sua Política de Investimentos e a Resolução nº 3922/2010 do Conselho Monetário Nacional, aplicou seus recursos de maneira diversificada em junho de 2015, distribuídos no Plano Financeiro e no Plano Previdenciário, conforme abaixo:

PLANO FINANCEIRO	Carteira Administr. Títulos Pub.Federais	Fundos de Investim. de Renda Fixa	Fundos de Investim. de Renda Variável	Fundos de Investim. de R.V. Multimercado	TOTAL GERAL DE APLICAÇÕES
QUANTID. DE APLICAÇÕES POR SEGMENTO DE INVESTIM.	2	25	30	5	62

PLANO PREVIDENCIÁRIO	Carteira Administr. Títulos Pub.Federais	Fundos de Investim. de Renda Fixa	Fundos de Investim. de Renda Variável	Fundos de Investim. de R.V. Multimercado	TOTAL GERAL DE APLICAÇÕES
QUANTID. DE APLICAÇÕES POR SEGMENTO DE INVESTIM.	1	16	6	1	24