

RELATÓRIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - JULHO/2016

ALOCACAO DOS RECURSOS DIVERSIFICACAO	E G M E N T O	VALOR R\$	RENTABILIDADE DO FUNDO		META ATUARIAL		EM RELACAO			
					INPC + 6%a.a.		META GERENCIAL		CDI	
					1,13	9,39	1,11	7,90	11,22	32,20
			NO MÊS	NO ANO 2016	NO MÊS	NO ANO 2016	NO MÊS	NO ANO 2016	NO MÊS	NO ANO 2016

PLANO FINANCEIRO

BANCO DO BRASIL S/A										
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)	R.F.	29.881.369,68								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	864.414.927,39	2,29	18,02	203,46	191,91	207,01	228,06		
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)	R.F.	21.730.625,82								
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	3.485.706,90	2,46	18,53	218,52	197,33	222,33	234,49		
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	123.420.044,33	1,13	7,69	100,32	81,91	102,06	97,34		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA II	R.F.	22.228.304,53	0,97	8,54	85,72	90,96	87,21	108,10		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	10.961.354,79	1,59	13,38	140,88	142,51	143,33	169,36		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	19.052.682,52	10,90	30,27	967,61	322,36			-0,32	-1,93
Brasil Ações IBrX Indexado FIC FI	R.V.	8.422.829,49	11,22	29,10	995,33	309,92			-0,00	-3,10
BB Ações Consumo FIC FI	R.V.	4.692.732,21	9,77	20,69	867,16	220,28			-1,45	-11,51
BB Ações Cielo FI	R.V.	22.666.484,73	8,34	30,53	739,98	325,08			-2,88	-1,67
BB Ações BB Seguridade FI em Ações	R.V.	15.396.146,87	7,05	26,54	625,67	282,60			-4,17	-5,66
TOTAL		1.146.353.209,26								

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
FI Caixa Brasil IPCA XIII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	24.700.212,50	0,93	8,70	82,63	92,69	84,07	110,15		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	70.629.653,40	1,11	7,91	98,42	84,22	100,13	100,09		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	112.949.707,62	2,39	18,20	212,02	193,80	215,72	230,30		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	20.949.074,43	1,19	9,96	105,69	106,02	107,53	125,99		
FIDC da Companhia Estadual de Águas e Esgotos-CEDAE	R.F.	983.703,60	-6,95	-33,45	-616,60	-356,23	-627,34	-423,33		
FIDC Casan Saneamento	R.F.	20.142.987,74	-0,28	-0,33	-25,13	-3,54	-25,57	-4,20		
Caixa Brasil IRE-M 1+ TP RF LP	R.F.	12.751.157,04	1,48	21,25	131,55	226,27	133,84	268,89		
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	14.827.134,85	10,43	19,01	925,83	202,43			-0,79	-13,19
Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS	R.V.	11.819.003,11	5,12	11,92	454,41	126,93			-6,10	-20,28
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	822.118,40	13,33	22,82	1.182,95	243,02			2,11	-9,38
Caixa FI Ações Institucional BDR Nível I	R.V.	4.618.104,12	5,08	-14,47	451,15	-154,06			-6,14	-46,67
FIP Caixa Integração e Logística	R.V.	-9.121,13	138,95	-133,76	12.331,47	-1.424,41			127,73	-165,96
FI Caixa Brasil IPCA V Multimercado Crédito Privado	M.M.	23.319.025,00	0,83	9,22	73,39	98,19	74,67	116,69		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	8.565.393,20	0,83	9,20	73,84	98,00	75,13	116,46		
FI Caixa Brasil IPCA VIII Multimercado Crédito Privado	M.M.	7.711.571,35	0,82	9,24	72,48	98,43	73,74	116,97		
TOTAL		334.779.725,23								

BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	239.143.141,88	2,48	18,61	220,05	198,23	223,89	235,57		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	125.418.374,40	1,68	14,75	148,85	157,03	151,45	186,61		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	5.764.361,47	3,33	24,38	295,92	259,66	301,08	308,58		
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.	11.549.823,51	13,65	31,69	1.211,49	337,52			2,43	-0,50
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	2.317.568,78	9,95	28,12	883,18	299,44			-1,27	-4,08
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	1.085.775,39	9,70	23,88	861,07	254,31			-1,52	-8,32
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	1.716.810,59	1,14	8,22	101,11	87,53	102,9	104,02		
TOTAL		386.995.856,02								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	122.812.464,58	2,47	18,72	218,94	199,40	222,75	236,96		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	13.383.929,01	1,17	9,88	104,08	105,26	105,89	125,08		
Itaú Institucional RF PRE LP FIC FI	R.F.	5.319.831,34	1,29	15,57	114,72	165,78	116,72	197,01		
Itaú FOF RPI Ações Ibovespa Ativo - FIC FI	R.V.	42.798.321,50	9,92	28,45	880,69	302,99			-1,30	-3,75
FIC FIP Kinea Private Equity II	R.V.	7.129.532,48	0,29	-10,33	25,86	-109,96			-10,93	-42,52
Itaú Ações Consumo FI	R.V.	3.978.471,36	10,08	21,75	894,36	231,61			-1,14	-10,45
Itaú Institucional Multimercado Juros e Moedas	M.M.	5.371.237,55	1,10	8,16	97,53	86,91	99,2	103,28		
TOTAL		200.793.787,82								

BANCO HSBC BANK BRASIL S/A										
Hsbc FI em Ações Ibovespa	R.V.	9.395.702,81	10,89	30,24	966,36	322,06			-0,33	-1,96
Hsbc FI Ações Ibovespa Valuation	R.V.	3.438.682,54	11,60	36,28	1.029,80	386,39			0,38	4,09
Hsbc FI de Ações Small Caps	R.V.	918.943,26	8,97	25,48	796,03	271,30			-2,25	-6,72
TOTAL		13.753.328,61								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	99.038.565,06	2,43	18,96	215,89	201,90	219,65	239,93		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	1.077.259,68	11,32	30,54	1.004,24	325,20			0,10	-1,66
TOTAL		100.115.824,74								

GWJ CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.										
GWJ Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	332.399,16	23,82	2,34	2.114,23	24,96			12,60	-29,86
TOTAL		332.399,16								

BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual Carteira Administrada	R.F.	124.129.404,34	2,52	12,48	223,35	132,92	227,25	157,96		
BTG Pactual Timberland Fund I - FIQ de FIP	R.V.	866.943,10	-0,89	-14,73	-79,19	-156,84			-12,11	0,00
TOTAL		124.996.347,44								

GERACAO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.										
Geracao Futuro Dividendos FIA	R.V.	2.614.233,20	9,00	-4,60	799,14	-49,03			-2,22	-36,80
TOTAL		2.614.233,20								

QUELUZ GESTAO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.										
Queluz Valor Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.988.100,15	8,31	22,70	737,71	241,77			-2,91	-9,50
TOTAL		1.988.100,15								

PATRIA INVESTIMENTOS LTDA.										
Patria Special Opportunities I - FIQ FIP	R.V.	6.473.515,86	-0,04	-0,24	-3,55	-2,58			-11,26	-32,44
P2 Brasil Infraestrutura III FIQ FIP	R.V.	854.797,06	1,15	14,85	102,43	158,09			-10,07	-17,35
TOTAL		7.328.312,92								

AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.										
AZ Quest Small Caps FIC de FIA	R.V.	4.335.690,00	10,21	21,36	905,87	227,43			-1,01	-10,84
TOTAL		4.335.690,00								

BRZ INVESTIMENTOS LTDA									
Terras Brasil - FIP	R.V.	1.836.180,33	-62,23	-62,52	-5.522,44	-665,78		-73,45	-94,72
TOTAL		1.836.180,33							
TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO		2.326.222.994,88	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 29/07/2016						

PLANO PREVIDENCIÁRIO									
CAIXA ECONOMICA FEDERAL									
Carteira Administrada Caixa Economica de TPF-NTN-B e NTN-F	R.F.	301.410.793,84	2,34	19,61	207,71	208,84	211,33	248,17	
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	75.254.023,07	2,39	18,20	212,02	193,80	215,72	230,30	
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	5.788.030,64	1,19	9,96	105,69	106,02	107,53	125,99	
FI Caixa Brasil IPCA XV Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	8.263.927,47	0,88	8,60	78,49	91,59	79,86	108,84	
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	17.337.442,00	1,11	7,91	98,42	84,22	100,13	100,09	
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	440.696,57	13,33	22,82	1.182,95	243,02			2,11
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	8.219.540,37	0,83	9,20	73,84	98,00	75,13	116,46	-9,38
TOTAL		416.714.453,96							
BANCO DO BRASIL S/A									
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	41.571.713,43	2,46	18,53	218,52	197,33	222,33	234,49	
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	6.614.973,25	1,59	13,38	140,88	142,51	143,33	169,36	
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	67.091.097,44	1,13	7,69	100,32	81,91	102,06	97,34	
BB Ações Cielo FI	R.V.	11.180.605,11	8,34	30,53	739,98	325,08			-2,88
TOTAL		126.458.389,23							-1,67
GTW CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.									
GTW Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	959.137,79	23,82	2,34	2.114,23	24,96		12,60	-29,86
TOTAL		959.137,79							
BANCO BTG PACTUAL									
BTG Pactual Absoluto Institucional FIQ de FI de Ações	R.V.	4.338.644,23	8,27	29,75					-2,95
TOTAL		4.338.644,23							-2,45
BANCO BRADESCO S/A									
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	16.576.152,97	2,48	18,61	220,05	198,23	223,89	235,57	
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	7.260.258,42	1,68	14,75	148,85	157,03	151,45	186,61	
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	15.654.656,80	3,33	24,38	295,92	259,66	301,08	308,58	
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	800.385,89	9,95	28,12	883,18	299,44			-1,27
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	579.878,68	9,70	23,88	861,07	254,31			-1,52
TOTAL		40.871.332,76							-8,32
ITAU UNIBANCO S/A									
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	11.391.138,84	2,47	18,72	218,94	199,40	222,75	236,96	
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	5.749.226,49	1,17	9,88	104,08	105,26	105,89	125,08	
TOTAL		17.140.365,33							
BANCO SANTANDER S/A									
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	4.331.213,79	2,43	18,96	215,89	201,90	219,65	239,93	
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	640.117,64	11,32	30,54	1.004,24	325,20		0,10	-1,66
TOTAL		4.971.331,43							
TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO		611.453.654,73	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 29/07/2016						
TOTAL GERAL APLICADO - (R\$)		2.937.676.649,61	PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO						

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 29/07/2016

PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	1.040.156.327,23	44,63%	23.651.165,15
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.034.082.574,62	44,37%	19.806.192,16
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	205.300.055,34	8,81%	13.597.042,34
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	46.684.037,69	2,00%	402.135,89
SALDO EM CONTAS CORRENTES	4.341.357,80	0,19%	
TOTALS	2.330.564.352,68	100,00%	57.456.535,54

PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	301.410.793,84	49,24%	6.894.058,05
FUNDOS DE RENDA FIXA	282.883.854,61	46,21%	5.408.255,30
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	18.939.465,91	3,09%	1.617.072,27
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	8.219.540,37	1,34%	67.825,13
SALDO EM CONTAS CORRENTES	706.958,41	0,12%	
TOTALS	612.160.613,14	100,00%	13.987.210,75

CONSOLIDAÇÃO DOS PLANOS NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - JULHO DE 2016			
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	1.341.567.121,07	45,59%	30.545.223,20
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.316.966.429,23	44,75%	25.214.447,46
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	224.239.521,25	7,62%	15.214.114,61
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	54.903.578,06	1,87%	469.961,02
SALDO EM CONTAS CORRENTES	5.048.316,21	0,17%	
TOTALS	2.942.724.965,82	100,00%	71.443.746,29

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 - JULHO DE 2016					Qtde. de Aplicaç.	
INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	PF	PP
BANCO DO BRASIL S/A	1.272.811.598,49	2.289.289,62	1.275.100.888,11	43,33%	10	4
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	751.494.179,19	2.234.461,21	753.728.640,40	25,61%	15	7
BANCO BRADESCO S/A	427.867.188,78	0,00	427.867.188,78	14,54%	7	5
ITAU UNIBANCO S/A	217.934.153,15	520.560,44	218.454.713,59	7,42%	7	2
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	13.753.328,61	4.004,45	13.757.333,06	0,47%	3	
BANCO SANTANDER S/A	105.087.156,17	0,49	105.087.156,66	3,57%	2	2
GWI CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.	1.291.536,95	0,00	1.291.536,95	0,04%	1	1
BANCO BTG PACTUAL	129.334.991,67	0,00	129.334.991,67	4,40%	2	1
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.	2.614.233,20	0,00	2.614.233,20	0,09%	1	
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.	1.988.100,15	0,00	1.988.100,15	0,07%	1	
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA	7.328.312,92	0,00	7.328.312,92	0,25%	2	
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	4.335.690,00	0,00	4.335.690,00	0,15%	1	
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	1.836.180,33	0,00	1.836.180,33	0,06%	1	
TOTAIS	2.937.676.649,61	5.048.316,21	2.942.724.965,82	100,00%	53	22

Em julho de 2016, os índices para atingimento das metas, atuarial e gerencial, são os seguintes:

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	ÍNDICE	JUL/2016	2016	ÍNDICE	JUL/2016	2016
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,13	9,39	C.D.I.	1,11	7,90
RENTA FIXA	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,13	9,39	C.D.I.	1,11	7,90
RENTA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,13	9,39	IBOVESPA	11,22	32,20
RENTA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,13	9,39	C.D.I.	1,11	7,90

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 julho de 2016, 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	18	28	5	53

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	13	7	1	22