

RELATÓRIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - MAIO/2016

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 2016	INPC + 6%a.a. NO MÊS	INPC + 6%a.a. NO ANO 2016	CDI NO MÊS	CDI NO ANO 2016	IBOVESPA (Diferença) NO MÊS	IBOVESPA (Diferença) NO ANO 2016

PLANO FINANCEIRO

BANCO DO BRASIL S/A										
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)	R.F.	29.219.430,41								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	828.491.545,41	0,06	13,27	4,19	185,63	5,56	241,39		
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)	R.F.	21.255.678,69								
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	3.340.601,49	-0,14	13,60	-9,67	190,24	-12,81	247,38		
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	119.711.023,31	1,14	5,37	77,79	75,08	103,03	97,64		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA II	R.F.	21.737.933,53	1,47	6,15	99,93	86,02	132,35	111,86		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	10.694.310,18	0,47	10,62	31,76	148,61	42,06	193,25		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	16.195.656,64	-10,22	10,74	-696,70	150,23			-0,13	-1,08
Brasil Ações IBrX Indexado FIC FI	R.V.	7.118.574,84	-9,51	9,11	-648,45	127,50			0,58	-2,70
BB Ações Consumo FIC FI	R.V.	4.068.861,72	-2,62	4,64	-178,60	64,94			7,47	-7,17
BB Ações Cielo FI	R.V.	19.680.542,67	-5,32	13,33	-362,91	186,55			4,77	1,52
BB Ações BB Seguridade FI em Ações	R.V.	13.966.071,26	-9,23	14,78	-629,58	206,88			0,85	2,97
TOTAL		1.095.480.230,15								

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
FI Caixa Brasil IPCA XI Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	24.707.075,00	1,23	6,30	83,92	88,19	111,14	114,68		
FI Caixa Brasil IPCA XII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	24.928.150,00	1,25	6,28	85,03	87,92	112,61	114,33		
FI Caixa Brasil IPCA XIII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	24.176.387,50	1,10	6,40	74,89	89,54	99,19	116,43		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	19.574.754,25	1,10	5,51	75,32	77,05	99,75	100,20		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	108.252.802,64	0,02	13,28	1,49	185,87	1,98	241,70		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	20.514.197,49	0,78	7,67	53,00	107,37	70,20	139,61		
FIDC da Companhia Estadual de Águas e Esgotos-CEDAE	R.F.	1.129.317,42	-5,99	-23,60	-408,17	-330,24	-540,61	-429,43		
FIDC Casan Saneamento	R.F.	20.165.280,86	0,10	-0,22	6,98	-3,10	9,25	-4,04		
Caixa Brasil IRF-M 1+ TP RF LP	R.F.	12.256.770,08	-0,02	16,55	-1,25	231,54	-1,65	301,08		
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	12.855.611,00	-9,75	3,18	-664,97	44,56			0,33	-8,63
Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS	R.V.	10.969.254,87	-3,31	3,87	-225,73	54,19			6,78	-7,94
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	677.467,84	-4,45	1,21	-303,11	16,94			5,64	-10,60
Caixa FI Ações Institucional BDR Nivel I	R.V.	4.977.810,78	6,96	-7,80	474,63	-109,21			17,05	-19,62
FIP Caixa Integração e Logística	R.V.	1.472,34	-77,68	-94,55	-5.295,63	-1.323,05			-67,59	-106,37
FI Caixa Brasil IPCA V Multimercado Crédito Privado	M.M.	22.834.050,00	1,12	6,95	76,48	97,24	101,30	126,45		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	8.386.724,60	1,12	6,92	76,27	96,90	101,02	126,00		
FI Caixa Brasil IPCA VIII Multimercado Crédito Privado	M.M.	7.552.704,48	1,15	6,99	78,72	97,85	104,27	127,23		
TOTAL		323.959.831,15								

BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	228.906.831,72	-0,15	13,54	-10,48	189,43	-13,88	246,33		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	121.099.078,52	0,47	10,79	31,80	151,04	42,12	196,41		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	5.435.028,13	-0,80	17,28	-54,63	241,76	-72,35	314,37		
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.	9.645.213,15	-3,16	9,98	-215,66	139,61			6,93	-1,84
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	1.982.991,82	-7,09	9,62	-483,12	134,65			3,00	-2,19
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	935.377,68	-1,22	6,72	-82,99	94,05			8,87	-5,09
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	1.677.063,26	1,03	5,71	70,35	79,96	93,2	103,97		
TOTAL		369.681.584,28								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	117.633.346,77	-0,13	13,72	-9,13	191,96	-12,09	249,61		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	13.231.122,76	0,76	7,64	52,08	106,89	68,98	139,00		
Itaú Institucional RF PRE LP FIC FI	R.F.	5.230.566,22	0,23	11,77	15,90	164,63	21,06	214,08		
Itaú FOF RPI Ações Ibovespa Ativo - FIC FI	R.V.	36.896.093,33	-5,01	10,74	-341,33	150,24			5,08	-1,08
FIC FIP Kinea Private Equity II	R.V.	7.502.690,98	5,35	-4,26	365,07	-59,68			15,44	-16,08
Itaú Ações Consumo FI	R.V.	3.435.376,77	-2,63	5,13	-179,26	71,78			7,46	-6,69
Itaú Institucional Multimercado Juros e Moedas	M.M.	5.254.256,33	1,01	5,81	68,80	81,24	91,1	105,63		
TOTAL		189.183.453,16								

BANCO HSBC BANK BRASIL S/A										
Hsbc FI em Ações Ibovespa	R.V.	7.990.156,18	-10,18	10,76	-693,97	150,56			-0,09	-1,06
Hsbc FI Ações Ibovespa Valuation	R.V.	2.885.269,24	-8,27	14,35	-563,71	200,81			1,82	2,54
Hsbc FI de Ações Small Caps	R.V.	794.339,25	-1,29	8,46	-87,80	118,41			8,80	-3,35
TOTAL		11.669.764,67								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	95.091.552,41	-0,06	13,95	-4,36	195,25	-5,77	253,89		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	913.614,89	-8,63	10,71	-588,02	149,83			1,46	-1,11
TOTAL		96.005.167,30								

GW CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.										
GW Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	241.196,20	-3,69	-25,74	-251,29	-360,14			6,40	-37,55
TOTAL		241.196,20								

BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual Carteira Administrada	R.F.	120.415.102,74	0,71	9,12	48,12	127,56	63,74	165,88		
BTG Pactual Timberland Fund I - FIQ de FIP	R.V.	906.937,81	-0,81	-10,79	-54,91	-151,05			9,28	0,00
TOTAL		121.322.040,55								

GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.										
Geração Futuro Dividendos FIA	R.V.	2.308.126,38	-8,02	-15,77	-546,79	-220,73			2,07	-27,59
TOTAL		2.308.126,38								

QUELUZ GESTAO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.										
Queluz Valor Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.760.668,43	-2,45	8,67	-166,83	121,27			7,64	-3,15
TOTAL		1.760.668,43								

PATRIA INVESTIMENTOS LTDA.										
Patria Special Opportunities I - FIQ FIP	R.V.	6.251.995,78	-0,06	-0,23	-3,89	-3,26			10,03	-12,05
P2 Brasil Infraestrutura III FIQ FIP	R.V.	766.020,99	2,67	11,90	182,35	166,52			12,76	0,09
TOTAL		7.018.016,77								

AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.										
AZ Quest Small Caps FIC de FIA	R.V.	3.757.220,20	-1,20	5,17	-81,70	72,27			8,89	-6,65
TOTAL		3.757.220,20								

BRZ INVESTIMENTOS LTDA										
Terras Brasil - FIP	R.V.	4.867.519,84	-0,13	-0,64	-9,04	-8,98			9,96	-12,46
TOTAL		4.867.519,84								

TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO		2.227.254.819,08	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 31/05/2016							
---	--	-------------------------	---	--	--	--	--	--	--	--

PLANO PREVIDENCIÁRIO

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	287.833.568,44	0,25	15,34	16,92	214,65	22,41	279,11		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	72.124.656,91	0,02	13,28	1,49	185,87	1,98	241,70		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	5.667.878,27	0,78	7,67	53,00	107,37	70,20	139,61		
FI Caixa Brasil IPCA XV Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	8.094.916,56	1,14	6,38	77,69	89,27	102,90	116,09		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	19.853.437,20	1,10	5,51	75,32	77,05	99,75	100,20		
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	363.156,64	-4,45	1,21	-303,11	16,94			5,64	-10,60
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	8.048.086,04	1,12	6,92	76,27	96,90	101,02	126,00		
TOTAL		401.985.700,06								

BANCO DO BRASIL S/A										
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	39.841.137,55	-0,14	13,60	-9,67	190,24	-12,81	247,38		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	6.453.816,81	0,47	10,62	31,76	148,61	42,06	193,25		
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	63.943.349,34	1,14	5,37	77,79	75,08	103,03	97,64		
BB Ações Cielo FI	R.V.	9.707.741,57	-5,32	13,33	-362,91	186,55			4,77	1,52
TOTAL		119.946.045,27								

GWJ CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.										
GWJ Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	695.971,64	-3,69	-25,74	-251,29	-360,14			6,40	-37,55
TOTAL		695.971,64								

BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual Absoluto Institucional FIQ de FI de Ações	R.V.	3.774.163,63	-2,69	12,87					7,40	1,06
TOTAL		3.774.163,63								

BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	15.866.625,42	-0,15	13,54	-10,48	189,43	-13,88	246,33		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	7.010.221,66	0,47	10,79	31,80	151,04	42,12	196,41		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	14.760.264,51	-0,80	17,28	-54,63	241,76	-72,35	314,37		
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	684.837,78	-7,09	9,62	-483,12	134,65			3,00	-2,19
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	499.555,96	-1,22	6,72	-82,99	94,05			8,87	-5,09
TOTAL		38.821.505,33								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	10.910.763,74	-0,13	13,72	-9,13	191,96	-12,09	249,61		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	5.631.758,27	0,76	7,64	52,08	106,89	68,98	139,00		
TOTAL		16.542.522,01								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	4.148.970,35	-0,06	13,95	-4,36	195,25	-5,77	253,89		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	542.878,40	-8,63	10,71	-588,02	149,83			1,46	-1,11
TOTAL		4.691.848,75								

TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO		586.457.756,69	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 31/05/2016							
---	--	-----------------------	---	--	--	--	--	--	--	--

TOTAL GERAL APLICADO - (R\$)		2.813.712.575,77	PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO							
-------------------------------------	--	-------------------------	--	--	--	--	--	--	--	--

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 31/05/2016

PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	999.381.757,25	44,84%	1.458.170,52
FUNDOS DE RENDA FIXA	997.816.130,28	44,77%	3.313.181,25
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	184.352.132,88	8,27%	-10.746.310,05
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	45.704.798,67	2,05%	501.949,33
SALDO EM CONTAS CORRENTES	1.400.308,89	0,06%	
TOTAIS	2.228.655.127,97	100,00%	-5.473.008,95

PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	287.833.568,44	49,08%	710.193,25
FUNDOS DE RENDA FIXA	274.307.796,59	46,77%	952.124,93
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	16.268.305,62	2,77%	-803.345,72
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	8.048.086,04	1,37%	89.040,07
SALDO EM CONTAS CORRENTES	3.668,00	0,00%	
TOTAIS	586.461.424,69	100,00%	948.012,53

CONSOLIDAÇÃO DOS PLANOS NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - MAIO DE 2016			
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	1.287.215.325,69	45,73%	2.168.363,77
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.272.123.926,87	45,19%	4.265.306,18
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	200.620.438,50	7,13%	-11.549.655,77
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	53.752.884,71	1,91%	590.989,40
SALDO EM CONTAS CORRENTES	1.403.976,89	0,05%	
TOTAIS	2.815.116.552,66	100,00%	-4.524.996,42

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 - MAIO DE 2016					Qtde. de Aplicaç.	
INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	PF	PP
BANCO DO BRASIL S/A	1.215.426.275,42	12.291,09	1.215.438.566,51	43,18%	10	4
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	725.945.531,21	1.387.400,64	727.332.931,85	25,84%	17	7
BANCO BRADESCO S/A	408.503.089,61	0,00	408.503.089,61	14,51%	7	5
ITAU UNIBANCO S/A	205.725.975,17	280,22	205.726.255,39	7,31%	7	2
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	11.669.764,67	4.004,45	11.673.769,12	0,41%	3	
BANCO SANTANDER S/A	100.697.016,05	0,49	100.697.016,54	3,58%	2	2
GWI CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.	937.167,84	0,00	937.167,84	0,03%	1	1
BANCO BTG PACTUAL	125.096.204,18	0,00	125.096.204,18	4,44%	2	1
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.	2.308.126,38	0,00	2.308.126,38	0,08%	1	
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.	1.760.668,43	0,00	1.760.668,43	0,06%	1	
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA	7.018.016,77	0,00	7.018.016,77	0,25%	2	
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	3.757.220,20	0,00	3.757.220,20	0,13%	1	
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	4.867.519,84	0,00	4.867.519,84	0,17%	1	
TOTAIS	2.813.712.575,77	1.403.976,89	2.815.116.552,66	100,00%	55	22

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

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	ÍNDICE	MAI/2016	2016	ÍNDICE	MAI/2016	2016
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,47	7,15	C.D.I.	1,11	5,50
RENTA FIXA	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,47	7,15	C.D.I.	1,11	5,50
RENTA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,47	7,15	IBOVESPA	-10,09	11,81
RENTA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,47	7,15	C.D.I.	1,11	5,50

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 maio 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	20	28	5	55

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