

RELATORIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - SETEMBRO/2016

ALOCACAO DOS RECURSOS DIVERSIFICACAO	E G M E N T O	VALOR R\$	RENTABILIDADE DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
					META ATUARIAL		META GERENCIAL			
					INPC + 6%a.a.		CDI		IBOVESPA (Diferença)	
			NO MÊS	NO ANO 2016	NO MÊS	NO ANO 2016	NO MÊS	NO ANO 2016	NO MÊS	NO ANO 2016
					0,57	10,89	1,11	10,42	0,80	34,64

PLANO FINANCEIRO

BANCO DO BRASIL S/A										
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)										
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	866.451.310,12	1,50	21,17	264,96	194,47	135,57	203,16		
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)		37.721.611,05								
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	3.577.852,44	1,64	21,66	289,95	198,98	148,36	207,88		
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	17.977.813,66	1,11	10,26	196,70	94,22	100,65	98,43		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA II	R.F.	22.799.451,83	1,01	11,33	178,79	104,08	91,48	108,73		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	11.315.238,97	1,75	17,04	309,16	156,55	158,19	163,55		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	19.351.244,90	0,60	32,31	105,40	296,80			-0,21	-2,33
Brasil Ações IBrX Indexado FIC FI	R.V.	8.553.610,09	0,52	31,11	91,17	285,74			-0,29	-3,53
BB Ações Consumo FIC FI	R.V.	4.805.986,89	2,14	23,60	377,21	216,76			1,33	-11,04
BB Ações Cielo FI	R.V.	24.863.739,17	-2,51	16,26	-442,15	149,34			-3,31	-18,38
BB Ações BB Seguridade FI em Ações	R.V.	20.797.087,99	2,37	28,74	418,03	263,97			1,56	-5,90
TOTAL		1.087.057.903,72								
CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	74.546.118,62	1,10	10,42	194,84	95,69	99,69	99,97		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	115.758.686,31	1,51	21,14	265,98	194,16	136,09	202,84		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	21.468.895,56	1,40	12,68	246,81	116,51	126,29	121,71		
FIDC da Companhia Estadual de Águas e Esgotos-CEDAE	R.F.	834.532,16	-8,28	-43,54	-1.460,95	-399,96	-747,53	-417,84		
FIDC Casan Saneamento	R.F.	20.167.513,09	-0,02	-0,21	-3,21	-1,94	-1,64	-2,02		
Caixa Brasil IRF-M 1+ TP RF LP	R.F.	64.946.721,73	2,31	25,16	408,24	231,14	208,89	241,47		
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	14.900.536,91	0,66	19,60	116,38	180,02			-0,15	-15,04
Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS	R.V.	11.923.482,50	0,02	12,91	2,94	118,57			-0,79	-21,73
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	817.177,54	0,22	22,08	38,29	202,84			-0,59	-12,56
Caixa FI Ações Institucional BDR Nivel I	R.V.	4.641.207,42	0,80	-14,04	140,80	-128,96			-0,01	-48,68
FIP Caixa Integração e Logística	R.V.	-20.463,15	-41,83	-175,74	-7.381,77	-1.614,20			-42,63	-210,38
FI Caixa Brasil IPCA V Multimercado Crédito Privado	M.M.	23.789.287,50	0,93	11,42	164,22	104,93	84,03	109,62		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	8.738.629,20	0,94	11,41	165,19	104,82	84,52	109,50		
FI Caixa Brasil IPCA VIII Multimercado Crédito Privado	M.M.	7.867.633,52	0,91	11,45	159,93	105,21	81,83	109,91		
TOTAL		370.379.958,91								
BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	245.371.128,61	1,67	21,70	294,31	199,36	150,59	208,27		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	128.992.155,39	1,70	18,02	300,83	165,48	153,92	172,88		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	5.911.249,22	1,68	27,55	295,77	253,09	151,34	264,40		
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.	11.397.841,15	-1,00	29,96	-177,16	275,21			-1,81	-4,68
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	2.297.721,96	-1,19	27,02	-210,04	248,20			-1,99	-7,62
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	1.101.538,13	1,40	25,68	246,84	235,88			0,59	-8,96
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	1.758.046,09	1,24	10,82	219,17	99,38	112,1	103,82		
TOTAL		396.829.680,55								
ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	125.723.228,16	1,52	21,54	268,03	197,84	137,14	206,69		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	14.189.693,02	1,38	12,58	242,81	115,54	124,24	120,71		
Itaú Institucional RF PRE LP FIC FI	R.F.	5.371.375,99	1,92	18,90	338,82	173,59	173,36	181,35		
Itaú FOF RPI Ações Ibovespa Ativo - FIC FI	R.V.	42.680.599,20	-0,22	28,10	-38,36	258,09			-1,02	-6,54
FIC FIP Kinea Private Equity II	R.V.	7.205.230,22	0,27	-9,96	47,17	-91,48			-0,54	-44,60
Itaú Ações Consumo FI	R.V.	4.077.253,77	2,11	24,77	372,02	227,54			1,30	-9,87
Itaú Institucional Multimercado Juros e Moedas	M.M.	5.504.133,39	1,24	10,84	218,24	99,54	111,7	103,99		
TOTAL		204.751.513,75								
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A										
Hsbc FI em Ações Ibovespa	R.V.	9.529.710,83	0,58	32,10	103,23	294,86			-0,22	-2,54
Hsbc FI Ações Ibovespa Valuation	R.V.	3.468.326,16	0,74	37,46	130,97	344,08			-0,06	2,82
Hsbc FI de Ações Small Caps	R.V.	896.662,51	-0,05	22,43	-8,41	206,06			-0,85	-12,21
TOTAL		13.894.699,50								
BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	101.523.430,40	1,58	21,94	278,60	201,56	142,55	210,57		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	1.077.243,66	-0,50	30,54	-88,15	280,48			-1,30	-4,11
TOTAL		102.600.674,06								
GTI CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.										
GTI Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	302.541,36	-13,05	-6,85	-2.302,54	-62,92			-13,85	-41,49
TOTAL		302.541,36								
BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual Carteira Administrada	R.F.	157.651.953,02	1,23	15,22	216,69	139,77	110,87	146,01		
BTG Pactual Timberland Fund I - FIQ de FIP	R.V.	994.370,77	1,38	-14,42	244,24	-132,46			0,58	0,00
TOTAL		158.646.323,79								
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.										
Geração Futuro Dividendos FIA	R.V.	2.681.493,55	0,93	-2,15	164,23	-19,75			0,13	-36,79
TOTAL		2.681.493,55								
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.										
Queluz Valor Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.971.026,69	0,40	21,65	71,25	198,86			-0,40	-12,99
TOTAL		1.971.026,69								
PATRIA INVESTIMENTOS LTDA.										
Patria Special Opportunities I - FIQ FIP	R.V.	6.470.854,51	-0,00	-0,28	-0,72	-2,60			-0,81	-34,92
P2 Brasil Infraestrutura III FIQ FIP	R.V.	944.842,50	2,33	16,40	411,66	150,62			1,53	-18,24
TOTAL		7.415.697,01								
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.										
AZ Quest Small Mid Caps FIC de FIA	R.V.	4.190.467,62	-1,43	17,29	-252,12	158,83			-2,23	-17,35
TOTAL		4.190.467,62								

BRZ INVESTIMENTOS LTDA											
Terras Brasil - FIP	R.V.	1.821.856,94	-0,40	-62,81	-71,21	-576,95				-1,21	-97,45
TOTAL		1.821.856,94									

TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO	2.352.543.837,45	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/09/2016
---	-------------------------	---

PLANO PREVIDENCIÁRIO

CAIXA ECONOMICA FEDERAL											
Carteira Administrada Caixa Economica de TPF-NTN-B e NTN-F	R.F.	367.325.817,77	1,20	22,71	211,07	208,59	108,00	217,91			
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	78.106.898,96	1,51	21,14	265,98	194,16	136,09	202,84			
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	5.931.652,29	1,40	12,68	246,81	116,51	126,29	121,71			
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	48.236.348,67	1,10	10,42	194,84	95,69	99,69	99,97			
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	438.048,02	0,22	22,08	38,29	202,84				-0,59	-12,56
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	8.385.781,46	0,94	11,41	165,19	104,82	84,52	109,50			
TOTAL		508.424.547,17									

BANCO DO BRASIL S/A											
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	42.670.672,23	1,64	21,66	289,95	198,98	148,36	207,88			
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	6.828.535,76	1,75	17,04	309,16	156,55	158,19	163,55			
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	3.913.555,99	1,11	10,26	196,70	94,22	100,65	98,43			
BB Ações Cielo FI	R.V.	14.633.358,33	-2,51	16,26	-442,15	149,34				-3,31	-18,38
BB Ações BB Seguridade FI em Ações	R.V.	5.133.175,83	2,37		418,03					1,56	
TOTAL		73.179.298,14									

GWI CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.											
GWI Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	872.983,11	-13,05	-6,85	-2.302,54	-62,92				-13,85	-41,49
TOTAL		872.983,11									

BANCO BTG PACTUAL											
BTG Pactual Absoluto Institucional FIQ de FI de Ações	R.V.	4.152.340,96	-1,19	24,18						-1,99	-10,46
TOTAL		4.152.340,96									

BANCO BRADESCO S/A											
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	17.007.844,46	1,67	21,70	294,31	199,36	150,59	208,27			
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	7.467.138,58	1,70	18,02	300,83	165,48	153,92	172,88			
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	16.053.569,55	1,68	27,55	295,77	253,09	151,34	264,40			
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	793.531,67	-1,19	27,02	-210,04	248,20				-1,99	-7,62
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	588.297,06	1,40	25,68	246,84	235,88				0,59	-8,96
TOTAL		41.910.381,32									

ITAU UNIBANCO S/A											
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	11.661.118,87	1,52	21,54	268,03	197,84	137,14	206,69			
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	5.890.216,08	1,38	12,58	242,81	115,54	124,24	120,71			
TOTAL		17.551.334,95									

BANCO SANTANDER S/A											
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	4.439.883,41	1,58	21,94	278,60	201,56	142,55	210,57			
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	640.108,12	-0,50	30,54	-88,15	280,48				-1,30	-4,11
TOTAL		5.079.991,53									

TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO	651.170.877,18	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/09/2016
---	-----------------------	---

TOTAL GERAL APLICADO - (R\$)	3.003.714.714,63	PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO
-------------------------------------	-------------------------	--

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 30/09/2016

PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	1.110.667.830,80	47,18%	16.086.828,18
FUNDOS DE RENDA FIXA	980.475.085,16	41,65%	15.310.482,07
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	213.743.191,79	9,08%	84.614,36
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	47.657.229,70	2,02%	459.846,20
SALDO EM CONTAS CORRENTES	1.582.225,76	0,07%	
TOTALS	2.354.126.063,21	100,00%	31.941.770,81

PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	367.325.817,77	56,35%	4.348.274,59
FUNDOS DE RENDA FIXA	248.207.434,85	38,07%	3.630.180,14
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	27.251.843,10	4,18%	-441.973,27
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	8.385.781,46	1,29%	77.770,46
SALDO EM CONTAS CORRENTES	727.489,60	0,11%	
TOTALS	651.898.366,78	100,00%	7.614.251,92

CONSOLIDAÇÃO DOS PLANOS NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - SETEMBRO DE 2016			
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	1.477.993.648,57	49,17%	20.435.102,77
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.228.682.520,01	40,87%	18.940.662,21
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	240.995.034,89	8,02%	-357.358,91
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	56.043.511,16	1,86%	537.616,66
SALDO EM CONTAS CORRENTES	2.309.715,36	0,08%	
TOTALS	3.006.024.429,99	100,00%	39.556.022,73

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 - SETEMBRO DE 2016					Qtde. de Aplicaç.	
INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	PF	PP
BANCO DO BRASIL S/A	1.160.237.201,86	2.231.560,74	1.162.468.762,60	38,67%	10	5
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	878.804.506,08	74.150,17	878.878.656,25	29,24%	14	6
BANCO BRADESCO S/A	438.740.061,87	0,00	438.740.061,87	14,60%	7	5
ITAU UNIBANCO S/A	222.302.848,70	0,00	222.302.848,70	7,40%	7	2
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	13.894.699,50	4.004,45	13.898.703,95	0,46%	3	
BANCO SANTANDER S/A	107.680.665,59	0,00	107.680.665,59	3,58%	2	2
GWI CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.	1.175.524,47	0,00	1.175.524,47	0,04%	1	1
BANCO BTG PACTUAL	162.798.664,75	0,00	162.798.664,75	5,42%	2	1
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.	2.681.493,55	0,00	2.681.493,55	0,09%	1	
QUELÚZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.	1.971.026,69	0,00	1.971.026,69	0,07%	1	
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA	7.415.697,01	0,00	7.415.697,01	0,25%	2	
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	4.190.467,62	0,00	4.190.467,62	0,14%	1	
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	1.821.856,94	0,00	1.821.856,94	0,06%	1	
TOTAIS	3.003.714.714,63	2.309.715,36	3.006.024.429,99	100,00%	52	22

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

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	INDICE	SET/2016	2016	INDICE	SET/2016	2016
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,57	10,89	C.D.I.	1,11	10,42
RENDA FIXA	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,57	10,89	C.D.I.	1,11	10,42
RENDA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,57	10,89	IBOVESPA	0,80	34,64
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,57	10,89	C.D.I.	1,11	10,42

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 setembro 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	17	28	5	52

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	12	8	1	22