

DEMONSTRATIVO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - FEVEREIRO/2017

ALOCÇÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO	S 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 2017	NO MÊS	NO ANO 2017	NO MÊS	NO ANO 2017
					0,73	1,64	0,87	1,96	3,08	10,68

PLANO FINANCEIRO

BANCO DO BRASIL S/A										
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)	R.F.	29.837.844,75								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	963.336.693,96	3,77	5,64	518,12	344,00	434,62	287,40		
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)	R.F.	39.945.452,65								
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	3.874.302,24	3,89	5,85	534,95	356,83	448,73	298,12		
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	33.522.250,21	0,89	2,00	122,67	121,90	102,90	101,84		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA II	R.F.	23.635.291,83	0,70	1,66	95,80	101,47	80,36	84,77		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	12.021.772,98	2,22	3,64	304,94	222,23	255,80	185,67		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	21.895.390,46	2,92	10,30	401,34	628,17			-0,16	-0,38
Brasil Ações IBRX Indexado FIC FI	R.V.	9.630.306,35	3,15	10,35	433,72	631,24			0,07	-0,33
BB Ações Consumo FIC FI	R.V.	4.522.078,28	0,81	3,99	111,48	243,05			-2,27	-6,70
BB Ações Cielo FI	R.V.	20.869.856,79	2,84	-2,03	390,54	-123,54			-0,24	-12,71
BB Ações BB Seguridade FI em Ações	R.V.	20.368.083,58	5,33	3,75	732,74	228,54			2,25	-6,94
TOTAL		1.183.459.324,08								

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	121.825.584,16	0,88	1,96	121,13	119,76	101,61	100,06		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	125.429.115,07	3,78	5,74	519,58	349,72	435,84	292,17		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	22.524.224,89	1,48	2,63	203,31	160,48	170,54	134,07		
FIDC da Companhia Estadual de Águas e Esgotos-CEDAE	R.F.	528.598,49	0,82	-12,33	112,89	-752,02	94,70	-628,29		
FIDC Casan Saneamento	R.F.	20.112.792,60	-0,15	-0,10	-21,03	-6,21	-17,64	-5,19		
Caixa Brasil IRF-M 1+ TP RF LP	R.F.	70.656.169,52	2,40	5,16	329,97	314,47	276,79	262,73		
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	16.741.504,80	3,10	9,79	425,92	596,82			0,02	-0,90
Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS	R.V.	12.743.419,99	4,44	7,39	610,64	450,36			1,36	-3,30
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	941.584,62	5,82	17,26	801,20	1.052,62			2,74	6,58
Caixa FI Ações Institucional BDR Nivel I	R.V.	4.847.181,45	3,47	0,65	477,37	39,69			0,39	-10,03
TOTAL		396.350.175,59								

BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	266.260.642,83	3,95	5,95	543,86	363,01	456,21	303,28		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	138.601.598,62	2,42	4,38	333,32	267,33	279,60	223,34		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	6.498.801,14	5,10	7,50	701,92	457,54	588,79	382,26		
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.	13.158.154,37	4,48	15,15	616,86	923,76			1,40	4,47
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	2.820.023,04	6,59	17,69	906,34	1.078,88			3,51	7,01
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	1.256.586,41	4,54	14,92	624,70	909,51			1,46	4,23
Bradesco H FI em Ações Ibovespa	R.V.	10.777.504,89	3,00	10,17	412,69	620,35			-0,08	-0,51
Bradesco H FI Ações Ibovespa Valuation	R.V.	4.007.235,43	4,49	13,51	618,36	823,99			1,42	2,83
Bradesco H FI de Ações Small Caps	R.V.	1.002.714,58	4,18	14,58	575,34	888,74			1,10	3,89
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	1.858.335,29	1,11	2,42	152,70	147,69	128,1	123,39		
TOTAL		446.241.596,60								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	135.793.981,28	3,81	5,71	523,81	347,88	439,39	290,64		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	14.874.913,71	1,46	2,60	201,33	158,60	168,88	132,50		
Itaú Institucional RF PRE LP FIC FI	R.F.	5.420.828,29	1,99	4,28	273,29	260,97	229,25	218,03		
Itaú FOF RPI Ações Ibovespa Ativo - FIC FI	R.V.	47.917.584,54	3,50	11,01	480,94	671,43			0,42	0,33
FIC FIP Kinea Private Equity II	R.V.	6.380.974,93	0,05	0,16	6,41	9,91			-3,03	-10,52
Itaú Ações Consumo FI	R.V.	3.849.946,22	0,85	4,15	116,85	253,05			-2,23	-6,53
Itaú Institucional Multimercado Juros e Moedas	M.M.	5.800.216,53	1,10	2,18	151,18	132,99	126,8	111,11		
TOTAL		220.038.445,50								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	109.616.600,35	3,83	5,76	527,17	351,00	442,21	293,25		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	1.350.503,62	6,52	17,20	897,12	1.048,64			3,44	6,51
TOTAL		110.967.103,97								

GW CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.										
GW Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	421.874,72	12,54	12,06	1.725,84	735,13			9,46	1,37
TOTAL		421.874,72								

BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual Carteira Administrada	R.F.	166.321.688,85	1,66	3,05	228,24	185,83	191,45	155,25		
BTG Pactual Timberland Fund I - FIQ de FIP	R.V.	1.313.010,00	3,19	2,65	438,59	161,52			0,11	0,00
TOTAL		167.634.698,85								

GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.										
Geração Futuro Dividendos FIA	R.V.	2.872.509,25	1,64	6,56	226,00	400,26			-1,44	-4,12
TOTAL		2.872.509,25								

QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.										
Queluz Valor Fundo de Investimento em Ações	R.V.	2.078.772,33	2,86	7,94	394,13	483,85			-0,21	-2,75
TOTAL		2.078.772,33								

PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA.										
Pátria Special Opportunities I - FIQ FIP	R.V.	6.732.133,92	-0,06	-0,28	-8,58	-17,22			-3,14	-10,97
P2 Brasil Infraestrutura III FIQ FIP	R.V.	1.362.813,09	-0,47	1,36	-64,55	82,76			-3,55	-9,33
TOTAL		8.094.947,01								

AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.										
AZ Quest Small Mid Caps FIC de FIA	R.V.	5.008.262,67	5,52	16,74	758,83	1.020,50			2,44	6,05
TOTAL		5.008.262,67								

BRZ INVESTIMENTOS LTDA										
Terras Brasil - FIP	R.V.	1.784.808,59	-0,38	-0,83	-52,18	-50,34			-3,46	-11,51
TOTAL		1.784.808,59								

TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO		2.544.952.519,16			DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 24/02/2017					
---	--	-------------------------	--	--	---	--	--	--	--	--

PLANO PREVIDENCIÁRIO											
CAIXA ECONOMICA FEDERAL											
Carteira Administrada Caixa Economica de TPF-NTN-B e NTN-F	R.F.	393.814.406,88	3,28	4,96	450,99	302,35	378,31	252,60			
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	84.631.914,32	3,78	5,74	519,58	349,72	435,84	292,17			
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	6.223.229,78	1,48	2,63	203,31	160,48	170,54	134,07			
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	59.651.802,11	0,88	1,96	121,13	119,76	101,61	100,06			
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	504.736,43	5,79	17,23	796,71	1.050,41			2,71	6,54	
TOTAL		544.826.089,52									
BANCO DO BRASIL S/A											
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	46.206.232,30	3,89	5,85	534,95	356,83	448,73	298,12			
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	7.254.915,86	2,22	3,64	304,94	222,23	255,80	185,67			
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	32.537.140,48	0,89	2,00	122,67	121,90	102,90	101,84			
BB Ações Cielo FI	R.V.	12.282.790,24	2,84	-2,03	390,54	-123,54			-0,24	-12,71	
BB Ações BB Seguridade FI em Ações	R.V.	5.027.288,16	5,33	3,75	732,74	228,54			2,25	-6,94	
TOTAL		103.308.367,04									
GTI CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.											
GTI Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.217.319,52	12,54	12,06	1.725,84	735,13			9,46	1,37	
TOTAL		1.217.319,52									
BANCO BTG PACTUAL											
BTG Pactual Absoluto Institucional FIQ de FI de Ações	R.V.	4.254.381,82	3,41	7,53	468,91	459,32			0,33	-3,15	
TOTAL		4.254.381,82									
BANCO BRADESCO S/A											
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	18.455.796,44	3,95	5,95	543,86	363,01	456,21	303,28			
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	8.023.413,06	2,42	4,38	333,32	267,33	279,60	223,34			
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	17.649.223,03	5,10	7,50	701,92	457,54	588,79	382,26			
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	973.911,40	6,59	17,69	906,34	1.078,88			3,51	7,01	
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	671.103,50	4,54	14,92	624,70	909,51			1,46	4,23	
TOTAL		45.773.447,43									
ITAU UNIBANCO S/A											
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	12.595.204,40	3,81	5,71	523,81	347,88	439,39	290,64			
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	6.174.654,79	1,46	2,60	201,33	158,60	168,88	132,50			
TOTAL		18.769.859,19									
BANCO SANTANDER S/A											
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	4.801.041,15	3,83	5,76	527,17	351,00	442,21	293,25			
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	802.481,71	6,52	17,20	897,12	1.048,64			3,44	6,51	
TOTAL		5.603.522,86									
TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO		723.752.987,38	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 24/02/2017								
TOTAL GERAL APLICADO - (R\$)		3.268.705.506,54	PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO								

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 24/02/2017

PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	1.199.441.680,21	47,05%	40.276.896,23
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.111.197.468,21	43,59%	31.881.066,22
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	226.654.818,92	8,89%	7.308.285,78
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	7.658.551,82	0,30%	83.437,90
SALDO EM CONTAS CORRENTES	4.123.397,65	0,16%	
TOTALS	2.549.075.916,81	100,00%	79.549.686,13

PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	393.814.406,88	54,35%	12.494.602,08
FUNDOS DE RENDA FIXA	304.204.567,72	41,98%	8.342.859,09
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	25.734.012,78	3,55%	1.035.333,29
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO		0,00%	
SALDO EM CONTAS CORRENTES	897.430,81	0,12%	
TOTALS	724.650.418,19	100,00%	21.872.794,46

CONSOLIDAÇÃO DOS PLANOS NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - FEVEREIRO DE 2017 PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	1.593.256.087,09	48,67%	52.771.498,31
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.415.402.035,93	43,24%	40.223.925,31
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	252.388.831,70	7,71%	8.343.619,07
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	7.658.551,82	0,23%	83.437,90
SALDO EM CONTAS CORRENTES	5.020.828,46	0,15%	
TOTALS	3.273.726.335,00	100,00%	101.422.480,59

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 - FEVEREIRO DE 2017					Qtde. de Aplicaç.	
INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	PF	PP
BANCO DO BRASIL S/A	1.286.767.691,12	3.599.262,23	1.290.366.953,35	39,42%	10	5
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	941.176.265,11	249.827,55	941.426.092,66	28,76%	10	5
BANCO BRADESCO S/A	492.015.044,03	1.525,55	492.016.569,58	15,03%	10	5
ITAU UNIBANCO S/A	238.808.304,69	1.170.212,64	239.978.517,33	7,33%	7	2
BANCO SANTANDER S/A	116.570.626,83	0,49	116.570.627,32	3,56%	2	2
GW CONSULT. PARTICIP. E SERV. LTDA.	1.639.194,24	0,00	1.639.194,24	0,05%	1	1
BANCO BTG PACTUAL	171.889.080,67	0,00	171.889.080,67	5,25%	2	1
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.	2.872.509,25	0,00	2.872.509,25	0,09%	1	
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.	2.078.772,33	0,00	2.078.772,33	0,06%	1	
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA	8.094.947,01	0,00	8.094.947,01	0,25%	2	
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	5.008.262,67	0,00	5.008.262,67	0,15%	1	
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	1.784.808,59	0,00	1.784.808,59	0,05%	1	
TOTAIS	3.268.705.506,54	5.020.828,46	3.273.726.335,00	100,00%	48	21

Em fevereiro de 2017, os índices para atingimento das metas, atuarial e gerencial, são os seguintes:

SEGMENTO	META ATUARIAL (%) - NO MES E NO ANO			META GERENCIAL (%) - NO MES E NO ANO		
	ÍNDICE	FEV/2017	2017	ÍNDICE	FEV/2017	2017
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IGBE) + 6% a.a.	0,73	1,64	C.D.I.	0,87	1,96
RENTA FIXA	INPC(IGBE) + 6% a.a.	0,73	1,64	C.D.I.	0,87	1,96
RENTA VARIÁVEL	INPC(IGBE) + 6% a.a.	0,73	1,64	IBOVESPA	3,08	10,68
RENTA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IGBE) + 6% a.a.	0,73	1,64	C.D.I.	0,87	1,96

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 fevereiro de 2017, 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	27	2	48

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	0	21