

DEMONSTRATIVO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - SETEMBRO/2017

ALOCÇÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO	SEGMENTO	VALOR R\$	RENTABILIDADE DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
			NO MÊS	NO ANO 2017	META ATUARIAL		META GERENCIAL		IBOVESPA (Diferença)	
					INPC + 6%a.a.	NO ANO 2017	NO MÊS	NO ANO 2017	NO MÊS	NO ANO 2017
			0,47	5,76	0,64	8,05	4,88	23,36		

PLANO FINANCEIRO

BANCO DO BRASIL S/A										
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)		31.648.682,68								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	997.762.716,28	1,72	12,86	368,61	223,18	268,26	159,79		
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)		37.762.288,49								
Carteira Administrada Banco do Brasil - Oper. Compr.-1 Dia		37.047.254,14								
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	4.143.408,75	1,84	13,20	395,22	229,20	287,63	164,09		
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	16.557.404,19	0,65	8,10	139,18	140,59	101,29	100,66		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	13.116.222,17	1,25	13,08	268,80	227,04	195,62	162,55		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	24.045.197,74	4,66	21,13	998,80	366,81			-0,22	-2,22
Brasil Ações IBRX Indexado FIC FI	R.V.	10.643.885,89	4,46	21,97	955,92	381,30			-0,42	-1,39
BB Ações Consumo FIC FI	R.V.	5.699.393,51	7,05	31,06	1.510,00	539,10			2,17	7,70
BB Ações Cielo FI	R.V.	20.587.706,33	-0,48	-3,35	-101,95	-58,16			-5,36	-26,71
BB Ações BB Seguridade FI em Ações	R.V.	20.772.250,53	3,15	5,81	673,82	100,79			-1,74	-17,55
TOTAL		1.219.786.410,70								
CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	131.530.863,66	0,63	8,06	135,83	139,85	98,85	100,13		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	133.705.466,22	1,79	12,71	383,66	220,66	279,21	157,98		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	24.317.445,38	0,99	10,80	212,49	187,51	154,64	134,25		
FIDC Casan Saneamento	R.F.	19.415.163,03	-1,24	-3,57	-266,60	-61,91	-194,02	-44,32		
Caixa Brasil IRF-M 1+ TP RF LP	R.F.	77.197.834,19	1,68	14,89	359,82	258,51	261,87	185,08		
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	18.814.113,43	6,13	23,38	1.312,84	405,82			1,25	0,03
Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS	R.V.	14.031.383,16	4,45	18,24	952,64	316,59			-0,44	-5,12
FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	1.160.885,23	4,39	44,58	939,86	773,71			-0,50	21,22
Caixa FI Ações Institucional BDR Nivel I	R.V.	5.251.539,50	1,58	9,05	338,51	157,04			-3,30	-14,31
TOTAL		425.424.693,80								
BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	284.989.876,75	1,83	13,41	391,10	232,70	284,63	166,60		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	148.830.880,27	1,37	12,09	294,24	209,82	214,14	150,22		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	12.573.023,23	2,36	14,35	505,67	249,02	368,01	178,28		
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.	11.643.155,58	2,15	23,23	460,04	403,15			-2,74	-0,13
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	14.512.471,05	3,76	28,06	805,87	486,96			-1,12	4,70
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	1.478.565,71	2,64	35,22	565,21	611,28			-2,24	11,86
Bradesco H FI em Ações Ibovespa	R.V.	11.829.565,19	4,65	20,93	995,72	363,27			-0,23	-2,43
Bradesco H FI Ações Ibovespa Valuation	R.V.	4.585.101,72	6,24	29,88	1.337,55	518,70			1,36	6,53
Bradesco H FI de Ações Small Caps	R.V.	1.196.029,38	3,14	36,67	673,37	636,41			-1,74	13,31
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	1.974.032,53	0,72	8,80	155,21	152,73	113,0	109,34		
TOTAL		493.612.701,41								
ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	105.605.421,41	1,78	12,76	380,49	221,56	276,90	158,63		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	15.976.696,84	0,97	10,61	208,58	184,19	151,80	131,87		
Itaú Institucional RF PRE LP FIC FI	R.F.	20.133.039,66	1,44	13,20	308,90	229,14	224,81	164,05		
Itaú Institucional RF Alocação Dinâmica II RF FICFI	R.F.	30.288.899,84	1,51	0,00	322,86	0,00	234,97	0,00		
Itaú FOF RPI Ações Ibovespa Ativo - FIC FI	R.V.	54.053.425,05	4,93	25,23	1.057,19	437,88			0,05	1,87
FIC FIP Kinea Private Equity II	R.V.	14.683.505,04	0,09	129,01	18,21	2.239,22			-4,80	105,65
Itaú Institucional Ações Phoenix	R.V.	4.712.434,50	5,09	0,00	1.091,30	0,00			0,21	-23,36
Itaú Institucional Multimercado Juros e Moedas	M.M.	6.091.517,41	0,65	7,31	139,43	126,93	101,5	90,88		
TOTAL		251.544.939,75								
BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	117.141.538,46	1,79	13,02	383,81	225,93	279,33	161,76		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	1.437.079,06	6,67	24,71	1.428,53	428,93			1,79	1,36
TOTAL		118.578.617,52								
GWJ CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.										
GWJ Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	247.689,85	-55,45	-34,21	-11.880,16	-593,78			-60,34	-57,56
TOTAL		247.689,85								
BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual Carteira Administrada	R.F.	177.411.533,34	1,37	9,92	293,68	172,16	213,73	123,26		
BTG Pactual Timberland Fund I - FIQ de FIP	R.V.	1.409.653,23	1,12	0,19	240,95	3,23			-3,76	0,00
TOTAL		178.821.186,57								
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.										
Geração Futuro Dividendos FIA	R.V.	2.774.227,90	2,04	2,92	436,50	50,66			-2,84	-20,44
TOTAL		2.774.227,90								
QUELUZ GESTAO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.										
Queluz Valor Fundo de Investimento em Ações	R.V.	2.328.278,04	4,19	20,89	898,24	362,61			-0,69	-2,46
TOTAL		2.328.278,04								
PATRIA INVESTIMENTOS LTDA.										
Patria Special Opportunities I - FIQ FIP	R.V.	6.693.155,92	-0,06	-0,86	-11,97	-14,92			-4,94	-24,21
P2 Brasil Infraestrutura III FIQ FIP	R.V.	2.886.296,27	11,68	19,69	2.501,55	341,83			6,79	-3,66
TOTAL		9.579.452,19								
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.										
AZ Quest Small Mid Caps FIC de FIA	R.V.	15.917.614,28	5,82	39,50	1.247,68	685,69			0,94	16,15
TOTAL		15.917.614,28								
BRZ INVESTIMENTOS LTDA										
Terras Brasil - FIP	R.V.	1.731.051,83	-0,41	-3,81	-87,59	-66,18			-5,29	-27,17
TOTAL		1.731.051,83								
TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO		2.720.346.863,84								DISPONIBILIDADE DAS APLICAÇÕES EM 29/09/2017

PLANO PREVIDENCIÁRIO

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Carteira Administrada Caixa Economica de TPF-NTN-B e NTN-F	R.F.	424.035.139,52	1,32	13,21	283,54	229,26	206,35	164,14		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	90.917.449,48	1,79	12,71	383,66	220,66	279,21	157,98		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	6.718.679,60	0,99	10,80	212,49	187,51	154,64	134,25		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	63.001.538,12	0,63	8,06	135,83	139,85	98,85	100,13		
FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	622.292,53	4,39	44,58	939,86	773,71			-0,50	21,22
TOTAL		585.295.099,23								

BANCO DO BRASIL S/A										
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	49.415.687,05	1,84	13,20	395,22	229,20	287,63	164,09		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	7.915.395,54	1,25	13,08	268,80	227,04	195,62	162,55		
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	15.815.381,04	0,65	8,10	139,18	140,59	101,29	100,66		
BB Ações Cielo FI	R.V.	12.116.732,80	-0,48	-3,35	-101,95	-58,16			-5,36	-26,71
BB Ações BB Seguridade FI em Ações	R.V.	5.127.045,40	3,15	5,81	673,82	100,79			-1,74	-17,55
TOTAL		90.390.241,83								

GWJ CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.											
GWJ Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	714.709,07	-55,45	-34,21	-11.880,16	-593,78				-60,34	-57,56
TOTAL		714.709,07									

BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual Absoluto Institucional FIQ de FI de Ações	R.V.	5.125.791,99	5,23	29,56	1.120,38	513,06			0,35	6,20
TOTAL		5.125.791,99								

BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	19.754.009,07	1,83	13,41	391,10	232,70	284,63	166,60		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	8.615.568,94	1,37	12,09	294,24	209,82	214,14	150,22		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	25.780.039,73	2,36	14,35	505,67	249,02	368,01	178,28		
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	12.139.604,93	3,76	28,06	805,87	486,96			-1,12	4,70
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	789.655,70	2,64	35,22	565,21	611,28			-2,24	11,86
TOTAL		67.078.878,37								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	13.436.340,84	1,78	12,76	380,49	221,56	276,90	158,63		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	6.656.743,60	0,97	10,61	208,58	184,19	151,80	131,87		
Itaú Institucional RF Alocação Dinâmica II RF FICFI	R.F.	6.966.915,27	1,51		322,86	0,00	234,97	0,00		
TOTAL		27.059.999,71								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	5.130.622,04	1,79	13,02	383,81	225,93	279,33	161,76		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	853.925,63	6,67	24,71	1.428,53	428,93			1,79	1,36
TOTAL		5.984.547,67								

AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.										
AZ Quest Small Mid Caps FIC de FIA	R.V.	12.295.969,87	5,82	0,00	1.247,68	0,00			0,94	-23,36
TOTAL		12.295.969,87								

TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO	793.945.237,74	DISPONIBILIDADE DAS APLICAÇÕES EM 29/09/2017
TOTAL GERAL APLICADO - (R\$)	3.514.292.101,58	PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 29/09/2017

PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	1.281.632.474,93	47,10%	21.165.198,28
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.155.523.184,05	42,46%	17.469.015,61
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	275.125.654,92	10,11%	9.785.519,83
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	8.065.549,94	0,30%	53.587,63
SALDO EM CONTAS CORRENTES	965.727,32	0,04%	
TOTAIS	2.721.312.591,16	100,00%	48.473.321,35

PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	424.035.139,52	53,41%	5.538.575,32
FUNDOS DE RENDA FIXA	320.124.370,30	40,32%	4.712.308,65
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	49.785.727,92	6,27%	680.056,77
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO		0,00%	
SALDO EM CONTAS CORRENTES	14.399,74	0,00%	
TOTAIS	793.959.637,48	100,00%	10.930.940,74

CONSOLIDAÇÃO DOS PLANOS NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - SETEMBRO DE 2017			
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	1.705.667.614,45	48,52%	26.703.773,60
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.475.647.554,35	41,98%	22.181.324,26
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	324.911.382,84	9,24%	10.465.576,60
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	8.065.549,94	0,23%	53.587,63
SALDO EM CONTAS CORRENTES	980.127,06	0,03%	
TOTAIS	3.515.272.228,64	100,00%	59.404.262,09

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 2017					Qtde. de Aplicaç.	
INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	PF	PP
					BANCO DO BRASIL S/A	1.310.176.652,53
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	1.010.719.793,03	456.175,40	1.011.175.968,43	28,77%	9	5
BANCO BRADESCO S/A	560.691.579,78	1.525,55	560.693.105,33	15,95%	10	5
ITAU UNIBANCO S/A	278.604.939,46	0,00	278.604.939,46	7,93%	8	3
BANCO BTG PACTUAL	183.946.978,56	0,00	183.946.978,56	5,23%	2	1
BANCO SANTANDER S/A	124.563.165,19	0,00	124.563.165,19	3,54%	2	2
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	28.213.584,15	0,00	28.213.584,15	0,80%	1	1
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA	9.579.452,19	0,00	9.579.452,19	0,27%	2	
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.	2.774.227,90	0,00	2.774.227,90	0,08%	1	
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.	2.328.278,04	0,00	2.328.278,04	0,07%	1	
GWÍ CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.	962.398,92	0,00	962.398,92	0,03%	1	1
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	1.731.051,83	0,00	1.731.051,83	0,05%	1	
TOTAIS	3.514.292.101,58	980.127,06	3.515.272.228,64	100,00%	47	23

Em setembro 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		
	INDICE	SET/2017	2017	INDICE	SET/2017	2017
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,47	5,76	C.D.I.	0,64	8,05
RENDA FIXA	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,47	5,76	C.D.I.	0,64	8,05
RENDA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,47	5,76	IBOVESPA	4,88	23,36
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,47	5,76	C.D.I.	0,64	8,05

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 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	16	27	2	47

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	9	0	23

DEMONSTRATIVO DE RENTABILIDADES DA CARTEIRA DA AMPREV E INDICADORES FINANCEIROS

RENTABILIDADE ACUMULADA DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV EM 2017 - (%)					RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS INDICADORES FINANCEIROS DO MERCADO BRASILEIRO PARA REFERÊNCIA DOS INVESTIMENTOS EM 2017 - (%)				
MÊS	META ATUARIAL INPC (+) 6% a.a. (no mês)	Rentabilidade Plano Financ. Mês	Rentabilidade Plano Previd. Mês	Rentabilidade Financ.+Previd. Mês	CDI	IMA-B 5	IMA-B 5+	IMA-B	IBOVESPA
jan-17	0,906729	1,975038	1,524442	1,874995	1,087275	1,156400	2,237000	1,866800	7,377886
fev-17	0,726802	3,226640	3,116315	3,202192	0,866440	1,492100	5,058200	3,849100	3,079165
mar-17	0,806855	0,904038	1,267907	0,984609	1,050428	1,390900	0,875100	1,044800	-2,517232
abr-17	0,566725	0,035112	0,051904	0,038846	0,788875	0,709800	-0,815500	-0,321900	0,645050
mai-17	0,846834	-0,995273	-0,899174	-0,973658	0,925570	0,084300	-1,776000	-1,188200	-4,115652
jun-17	0,186835	0,437474	0,470895	0,445010	0,811685	0,524614	-0,055491	0,164462	0,300583
jul-17	0,656681	3,682022	3,593804	3,662075	0,800778	2,846387	4,673602	3,997593	4,801894
ago-17	0,456784	1,476366	1,413836	1,462213	0,801422	1,254614	1,362561	1,342815	7,455496
set-17	0,466768	1,814207	1,396008	1,719427	0,641373	1,006630	2,398695	1,810809	4,882399
out-17									
nov-17									
dez-17									
Acumulado	5,761300	13,181420	12,503123	13,028410	8,047101	10,940069	14,617666	13,157080	23,355230