

DEMONSTRATIVO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - MARÇO/2019

ALOCÇÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO	SEGMENTO	VALOR R\$	RENTABILIDADE DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
					META ATUARIAL		META GERENCIAL			
					INPC + 6%a.a.		CDI		IBOVESPA (Diferença)	
			NO MÊS	NO ANO 2019	NO MÊS	NO ANO 2019	NO MÊS	NO ANO 2019	NO MÊS	NO ANO 2019
			1,26	3,16	0,47	1,51	-0,18	8,56		

PLANO FINANCEIRO

BANCO DO BRASIL S/A										
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)		168.193.467,22								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	1.048.842.348,96	0,55	5,25	44,12	166,07	118,28	347,16		
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)		72.571.736,77								
Carteira Administrada Banco do Brasil - Oper. Compr.-1 Dia		21.750.196,65								
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	192.220,76	0,55	5,46	43,62	172,76	116,94	361,15		
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	12.244.754,74	0,46	1,48	36,67	46,89	98,32	98,03		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	15.219.906,54	0,80	2,90	63,74	91,66	170,87	191,61		
BB Previdenciário Renda Fixa Fluxo FIC FI	R.F.	6.642,03	0,39	1,25	30,74	39,42	82,41	82,41		
Brasil Ações IBRX Indexado FIC FI	R.V.	13.233.537,93	-0,28	8,10	-22,26	256,19			-0,10	-0,46
BB Ações Consumo FIC FI	R.V.	0,00	-0,86	6,31	-68,52	199,52			-0,68	-2,25
BB Ações Setor Financeiro FIC de Fundos de Investimento	R.V.	27.129.132,33	-2,11	8,20	-168,12	259,13			-1,94	-0,37
TOTAL		1.379.383.943,99								

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	109.011.782,93	0,47	1,49	37,11	46,97	99,48	98,20		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	163.237.470,04	0,56	5,48	44,54	173,20	119,42	362,06		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	27.817.862,38	0,76	2,85	60,82	89,95	163,07	188,04		
FIDC Casan Saneamento	R.F.	14.574.969,74	-1,85	-5,17	-147,23	-163,48	-394,73	-341,74		
Caixa Brasil IRF-M 1+ TP RF LP	R.F.	112.358.248,53	0,59	2,48	47,12	78,33	126,33	163,74		
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	20.708.451,27	-0,36	7,97	-28,98	251,86			-0,19	-0,60
Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS	R.V.	17.602.604,37	-0,70	11,88	-55,54	375,73			-0,52	3,32
FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	0,00	-0,25	7,08	-19,60	223,97			-0,07	-1,48
Caixa FI Ações Institucional BDR Nivel I	R.V.	18.968.225,43	6,12	13,01	486,73	411,41			6,29	4,45
FI Caixa Multimercado RV 30 Longo Prazo	M.M.	11.092.166,53	0,23	3,29	18,17	104,06			0,41	-5,27
TOTAL		495.371.781,34								

BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	174.268.074,93	0,51	5,55	40,72	175,43	109,17	366,72		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	108.351.356,54	0,50	2,95	39,89	93,39	106,94	195,23		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	11.171.205,28	0,38	7,55	30,08	238,60	80,63	498,77		
Bradesco H Fundo de Investimento Renda Fixa Nilo	R.F.	91.879.463,68	0,44	5,44	34,71	171,95	93,06	359,46		
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	92.289.874,50	-0,48	7,00	-38,16	221,41			-0,30	-1,56
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	54.545.727,34	-0,56	5,62	-44,30	177,83			-0,38	-2,94
Bradesco H FI em Ações Ibovespa	R.V.	7.141.265,31	-0,27	8,04	-21,54	254,26			-0,09	-0,52
Bradesco H FI Ações Ibovespa Valuation	R.V.	10.861.897,13	6,42	4,38	511,02	138,42			6,60	-4,19
Bradesco FIC de FIA Institucional IBRX Alpha	R.V.	6.531.809,66	0,15	7,08	12,09	223,74			0,33	-1,49
Bradesco FI em Ações Selection	R.V.	44.495.096,81	0,24	5,02	18,86	158,75			0,41	-3,54
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	0,00	0,38	1,39	30,40	44,02			0,56	-7,17
TOTAL		601.535.771,20								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	48.031.895,63	0,55	5,41	43,56	170,95	116,78	357,36		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	18.122.519,21	0,76	2,80	60,52	88,52	162,25	185,04		
Itaú Institucional RF PRE LP FIC FI	R.F.	22.190.538,70	0,56	2,17	44,25	68,72	118,62	143,65		
Itaú Institucional RF Alocação Dinâmica II RF FICFI	R.F.	41.670.225,41	0,39	3,12	31,22	98,77	83,70	206,48		
Itaú Soberano Renda Fixa Simples LP FICFI	R.F.	148.151,25	0,46		36,43	0,00	97,66	0,00		
Itaú FOF RPI Ações Ibovespa Ativo - FIC FI	R.V.	68.107.080,62	-0,79	7,26	-63,00	229,70			-0,61	-1,30
FIC FIP Kinea Private Equity II	R.V.	8.221.856,90	-1,82	-20,81	-144,54	-657,90			-1,64	-29,37
Itaú Institucional Ações Phoenix	R.V.	33.953.730,56	-0,92	5,69	-73,24	179,94			-0,74	-2,87
Kinea Private Equity IV Feeder Instituc. I FIP Multiestrategia	R.V.	4.207.604,46	-2,61	-10,23	-207,95	-323,59			-2,44	-18,80
TOTAL		244.653.602,80								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	84.100.353,38	0,56	5,47	44,41	172,97	119,06	361,58		
Santander FI IRF-M Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	22.444.729,33	0,56	2,22	44,77	70,29	120,01	146,94		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	0,00	-1,82	3,79	-144,71	119,69			-1,64	-4,78
TOTAL		106.545.082,71								

BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual Carteira Administrada	R.F.	202.109.509,05	0,53	2,89	42,48	91,22	113,88	190,70		
BTG Pactual Timberland Fund I - FIQ de FIP	R.V.	2.986.342,10	3,57	10,36	284,05	327,53			3,75	1,79
BTG Pactual Absoluto Institucional FIQ de FIA	R.V.	6.350.399,45	-1,42	4,12	-113,12	130,37			-1,24	-4,44
TOTAL		211.446.250,60								

QUELUZ GESTAO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.										
Queluz Valor Fundo de Investimento em Ações	R.V.	2.901.648,47	-0,90	7,84	-71,83	247,82			-0,73	-0,73
TOTAL		2.901.648,47								

PATRIA INVESTIMENTOS LTDA.										
Patria Special Opportunities I - FIQ FIP	R.V.	7.014.651,39	-0,08	-0,26	-6,31	-8,16			0,10	-8,82
P2 Brasil Infraestrutura III FIQ FIP	R.V.	5.374.239,16	4,34	3,95	345,67	124,87			4,52	-4,62
TOTAL		12.388.890,55								

AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.										
AZ Quest Small Mid Caps FIC de FIA	R.V.	45.696.742,59	-1,68	1,65	-134,00	52,02			-1,51	-6,92
AZ Quest Ações FIC FI de Ações	R.V.	26.625.478,80	-0,79	4,04	-62,76	127,79			-0,61	-4,52
TOTAL		72.322.221,39								

BRZ INVESTIMENTOS LTDA.										
Terras Brasil - FIP	R.V.	2.454.968,02	-3,08	-3,76	-245,36	-118,91			-2,91	-12,33
TOTAL		2.454.968,02								

ICATU VANGUARDA GESTAO DE RECURSOS LTDA.										
Icatu Vanguarda Dividendos Fundo de Investimento em Ações	R.V.	11.627.285,11	-0,81	9,22	-64,06	291,63			-0,63	0,66
TOTAL		11.627.285,11								

BANCO SAFRA S/A										
Safra S&P Reais PB FI Multimercado	M.M.	17.141.379,27	1,98	13,43	157,24	424,52			2,15	4,86
TOTAL		17.141.379,27								

TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO	3.157.772.825,45	DISPONIBILIDADE DAS APLICAÇÕES - MARÇO/2019 (29/03/2019)
---	-------------------------	---

PLANO PREVIDENCIÁRIO

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Carteira Administrada Caixa Economica de TPF-NTN-B e NTN-F	R.F.	469.764.716,02	0,88	3,42	69,68	108,19	186,82	226,16		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	128.252.515,44	0,56	5,48	44,54	173,20	119,42	362,06		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	7.685.811,62	0,76	2,85	60,82	89,95	163,07	188,04		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	69.805.043,74	0,47	1,49	37,11	46,97	99,48	98,20		
Caixa Brasil IRF-M 1+ TP RF LP	R.F.	15.540.871,78	0,59	2,48	47,12	78,33	126,33	163,74		
FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	0,00	-0,25	7,08	-19,60	223,97			-0,07	-1,48
TOTAL		691.048.958,57								

BANCO DO BRASIL S/A										
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	69.261.215,78	0,55	5,46	43,62	172,76	116,94	361,15		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	9.184.929,84	0,80	2,90	63,74	91,66	170,87	191,61		
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	15.319.448,17	0,46	1,48	36,67	46,89	98,32	98,03		
BB Ações Setor Financeiro FIC de Fundos de Investimento	R.V.	4.375.652,62	-2,11	8,20	-168,12	259,13			-1,94	-0,37
TOTAL		98.141.246,41								

BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual Absoluto Institucional FIQ de FI de Ações	R.V.	25.687.666,19	-1,42	4,12	-113,12	130,37			-1,24	-4,44
TOTAL		25.687.666,19								

BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	15.943.979,45	0,51	5,55	40,72	175,43	109,17	366,72		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	8.209.148,01	0,50	2,95	39,89	93,39	106,94	195,23		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	14.113.664,69	0,38	7,55	30,08	238,60	80,63	498,77		
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	16.086.580,80	-0,48	7,00	-38,16	221,41			-0,30	-1,56
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	1.818.378,77	-0,56	5,62	-44,30	177,83			-0,38	-2,94
Bradesco FI em Ações Selection	R.V.	16.310.815,35	0,24	5,02	18,86	158,75			0,41	-3,54
TOTAL		72.482.567,07								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	7.590.284,63	0,76	2,80	60,52	88,52	162,25	185,04		
Itaú Institucional RF Alocação Dinâmica II RF FICFI	R.F.	7.851.109,63	0,39	3,12	31,22	98,77	83,70	206,48		
Itaú Institucional Ações Phoenix	R.V.	12.725.441,03	-0,92	5,69	-73,24	179,94			-0,74	-2,87
TOTAL		28.166.835,29								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	5.399.212,00	0,56	5,47	44,41	172,97	119,06	361,58		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	0,00	-1,82	3,79	-144,71	119,69			-1,64	-4,78
TOTAL		5.399.212,00								

AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.										
AZ Quest Small Mid Caps FIC de FIA	R.V.	15.959.494,39	-1,68	1,65	-134,00	52,02			-1,51	-6,92
AZ Quest Ações FIC FI de Ações	R.V.	21.311.102,93	-0,79	4,04	-62,76	127,79			-0,61	-4,52
TOTAL		37.270.597,32								

ICATU VANGUARDA GESTAO DE RECURSOS LTDA.										
Icatu Vanguarda Dividendos Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.027.148,54	-0,81		-64,06				-0,63	
TOTAL		1.027.148,54								

TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO	959.224.231,39	DISPONIBILIDADE DAS APLICAÇÕES - MARÇO/2019 (29/03/2019)
---	-----------------------	---

TOTAL GERAL APLICADO - (R\$)	4.116.997.056,84	PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO
-------------------------------------	-------------------------	--

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - MARÇO/2019 (29/03/2019)

PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	1.513.467.258,65	47,93%	8.406.600,26
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.077.035.729,20	34,11%	5.774.580,27
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	539.036.291,80	17,07%	-2.600.424,03
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	28.233.545,80	0,89%	359.556,14
SALDO EM CONTAS CORRENTES	56.705,11	0,00%	
TOTAIS	3.157.829.530,56	100,00%	11.940.312,64

PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	469.764.716,02	48,97%	4.078.499,94
FUNDOS DE RENDA FIXA	374.157.234,75	39,01%	1.969.106,14
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	115.302.280,62	12,02%	-1.066.054,89
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO		0,00%	
SALDO EM CONTAS CORRENTES	7.808,19	0,00%	
TOTAIS	959.232.039,58	100,00%	4.981.551,19

CONSOLIDAÇÃO DOS PLANOS NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - MARÇO/2019 (29/03/2019)			
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	1.983.231.974,67	48,17%	12.485.100,20
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.451.192.963,95	35,25%	7.743.686,41
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	654.338.572,42	15,89%	-3.666.478,92
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	28.233.545,80	0,69%	359.556,14
SALDO EM CONTAS CORRENTES	64.513,30	0,00%	
TOTAIS	4.117.061.570,14	100,00%	16.921.863,83

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

PERFORMANCE DOS INVESTIMENTO - RANKING DE RENTABILIDADE EM 2019 - Letra "J", Item 5 do Regulamento do CIAP					
PRODUTOS DE INVESTIMENTO DOS RECURSOS	Segmento	Valor/Posição - R\$	Rentab. Mar/19 - %	Rentab. Ano 2019 - %	RANKING
Safra S&P Reais PB FI Multimercado	M.M.	17.141.379,27	1,98	13,43	1º
Caixa FI Ações Institucional BDR Nivel I	R.V.	18.968.225,43	6,12	13,01	2º
Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS	R.V.	17.602.604,37	-0,70	11,88	3º
Icatu Vanguarda Dividendos Fundo de Investimento em Ações	R.V.	11.627.285,11	-0,81	9,22	4º
BB Ações Setor Financeiro FIC de Fundos de Investimento	R.V.	27.129.132,39	-2,11	8,20	5º

DISPONIBILIDADE POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - MARÇO/2019 (29/03/2019)						Qtde. de Aplicaç.	
INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	PF	PP	
BANCO DO BRASIL S/A	1.477.525.190,40	59.962,43	1.477.585.152,83	35,89%	8	4	
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	1.186.420.739,91	4.424,57	1.186.425.164,48	28,82%	10	6	
BANCO BRÁDESCO S/A	674.018.338,27	125,81	674.018.464,08	16,37%	11	6	
ITAU UNIBANCO S/A	272.820.438,09	0,00	272.820.438,09	6,63%	9	3	
BANCO BTG PACTUAL	237.133.916,79	0,00	237.133.916,79	5,76%	3	1	
BANCO SANTANDER S/A	111.944.294,71	0,49	111.944.295,20	2,72%	3	2	
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	109.592.818,71	0,00	109.592.818,71	2,66%	2	2	
BANCO SAFRA S/A	17.141.379,27	0,00	17.141.379,27	0,42%	1		
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA	12.388.890,55	0,00	12.388.890,55	0,30%	2		
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA.	12.654.433,65	0,00	12.654.433,65	0,31%	1	1	
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	2.454.968,02	0,00	2.454.968,02	0,06%	1		
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.	2.901.648,47	0,00	2.901.648,47	0,07%	1		
TOTAIS	4.116.997.056,84	64.513,30	4.117.061.570,14	100,00%	52	25	

Em março de 2019, os índices para atingimento das metas, atuarial e gerencial, são os seguintes:

SEGMENTO	META ATUARIAL (%) - NO MÊS E NO ANO			META GERENCIAL (%) - NO MÊS E NO ANO		
	ÍNDICE	MAR/2019	2019	ÍNDICE	MAR/2019	2019
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,26	3,16	C.D.I.	0,47	1,51
RENDA FIXA	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,26	3,16	C.D.I.	0,47	1,51
RENDA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,26	3,16	IBOVESPA	-0,18	8,56
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,26	3,16	C.D.I.	0,47	1,51

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 março de 2019, 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	27	3	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	14	10	0	25

DEMONSTRATIVO DE RENTABILIDADES DA CARTEIRA EM COMPARAÇÃO COM A META ATUARIAL DE INPC + 6% a.a.

RENTABILIDADE ACUMULADA DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV EM 2019 - (%)									Rentabilidade dos Principais Indicadores Financeiros do Mercado Brasileiro para Referência dos Investimentos em 2019 - (%)				
MÊS	META ATUARIAL - INPC (+) 6% a.a. (no mês)	Meta Atuarial INPC + 6% a.a. Rentab. Acum. %	Rentabilidade Plano Financ. no Mês	Rentabilidade Acumulada Plano Financeiro - %	Rentabilidade Plano Previd. no Mês	Rentabilidade Acumulada Plano Previdenciár. - %	Rentabilidade Financeiro + Previdenciár. no Mês	Rentabilidade Acumulada da Carteira AMPREV - %	CDI	IMA-B 5	IMA-B 5+	IMA-B	IBOVESPA
jan-19	0,846795	0,846795	4,214373	4,214373	3,151515	3,151515	3,967257	3,967257	0,5431	1,5396	6,6111	4,3661	10,8167
fev-19	1,026789	1,882279	0,157033	4,378024	0,181217	3,338443	0,162627	4,136336	0,4936	0,5463	0,5498	0,5465	-1,8578
mar-19	1,256829	3,162765	0,379560	4,774200	0,522042	3,877914	0,412721	4,566128	0,4688	0,7845	0,4317	0,5799	-0,1776
abr-19													
mai-19													
jun-19													
jul-19													
ago-19													
set-19													
out-19													
nov-19													
dez-19													
Acumulado	3,162765		4,774200		3,877914		4,566128		1,5130	2,8952	7,6600	5,5450	8,5647

