

DEMONSTRATIVO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - SETEMBRO/2018

ALOCÇÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO	SEGMENTO	VALOR R\$	RENTABILIDADE DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
			NO MÊS	NO ANO 2018	META ATUARIAL		META GERENCIAL			
					INPC + 6%a.a.		CDI		IBOVESPA (Diferença)	
					NO MÊS	NO ANO 2018	NO MÊS	NO ANO 2018	NO MÊS	NO ANO 2018
				0,79	7,73	0,47	4,81	3,48	3,85	

PLANO FINANCEIRO

BANCO DO BRASIL S/A										
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)		15.334.977,97								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)		982.070.188,33								
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)	R.F.	62.133.863,49	-0,30	2,74	-38,65	35,49	-64,96	56,99		
Carteira Administrada Banco do Brasil - Oper. Compr.-1 Dia		73.313.671,17								
Carteira Administrada Banco do Brasil - Oper. Compr.-Longo		0,00								
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	165.987,70	-0,17	2,75	-21,27	35,63	-35,75	57,22		
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	127.038.620,13	0,49	4,77	62,47	61,72	105,01	99,11		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	14.172.590,26	0,89	6,33	112,67	81,97	189,40	131,63		
BB Top Renda Fixa Curto Prazo Fundo de Investimento	R.F.	0,00	0,47	0,00	59,41	0,00	99,87	0,00		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	18.115.605,68	3,26	2,20	414,44	28,48			-0,21	-1,65
Brasil Ações IbrX Indexado FIC FI	R.V.	11.027.548,12	3,04	1,54	386,09	19,89			-0,44	-2,31
BB Ações Consumo FIC FI	R.V.	4.718.327,53	0,44	-17,11	55,59	-221,49			-3,04	-20,96
BB Ações Setor Financeiro FIC de Fundos de Investimento	R.V.	16.267.112,70	2,56		325,49				-0,91	
TOTAL		1.324.358.493,08								

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	131.214.051,11	0,44	4,65	56,49	60,24	94,96	96,74		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	137.107.888,27	-0,13	2,87	-15,99	37,11	-26,88	59,60		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	25.844.190,18	0,86	4,79	108,89	61,93	183,04	99,46		
FIDC Casan Saneamento	R.F.	16.235.107,39	-2,08	-13,17	-263,77	-170,41	-443,38	-273,67		
Caixa Brasil IRF-M 1+ TP RF LP	R.F.	101.258.680,81	1,42	3,72	180,70	48,09	303,74	77,22		
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	17.605.343,51	3,19	3,17	405,75	41,06			-0,28	-0,68
Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS	R.V.	12.833.366,77	-1,51	-9,66	-192,34	-125,07			-4,99	-13,51
FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	6.367.651,13	-2,16	-10,91	-274,17	-141,24			-5,63	-14,76
Caixa FI Ações Institucional BDR Nivel I	R.V.	7.858.130,12	-0,59	32,87	-75,25	425,39			-4,07	29,02
FI Caixa Multimercado RV 30 Longo Prazo	M.M.	10.316.021,71	1,24		157,70		265,1			
TOTAL		466.640.431,00								

BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	149.697.597,94	-0,22	2,33	-28,43	30,16	-47,79	48,44		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	99.647.994,16	0,62	4,19	78,89	54,25	132,61	87,12		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	9.091.421,34	-1,05	0,69	-133,56	8,92	-224,51	14,33		
Bradesco H Fundo de Investimento Renda Fixa Nilo	R.F.	59.676.192,48	-0,35		-44,26		-74,39			
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	29.215.695,27	3,47	6,40	440,62	82,83			-0,01	2,55
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	19.373.293,67	1,29	2,71	163,36	35,13			-2,19	-1,13
Bradesco H FI em Ações Ibovespa	R.V.	5.984.769,09	3,34	2,42	424,24	31,32			-0,14	-1,43
Bradesco H FI Ações Ibovespa Valuation	R.V.	10.229.102,98	3,43	8,00	435,80	103,49			-0,05	4,15
Bradesco FIC de FIA Institucional IBRX Alpha	R.V.	5.418.238,96	3,49		443,42				0,01	
Bradesco Fia Selection	R.V.	5.490.651,18	4,25		540,74				0,78	
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	1.386.880,13	0,50	4,22	63,62	54,58	106,9	87,65		
TOTAL		395.211.837,17								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	41.539.896,28	-0,18	2,51	-23,49	32,54	-39,48	52,26		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	16.863.218,73	0,85	4,66	108,63	60,28	182,59	96,81		
Itaú Institucional RF PRE LP FIC FI	R.F.	20.694.076,54	1,26	3,91	159,98	50,58	268,92	81,23		
Itaú Institucional RF Alocação Dinâmica II RF FICFI	R.F.	39.314.952,72	0,42	5,31	53,03	68,67	89,14	110,27		
Itaú FOF RPI Ações Ibovespa Ativo - FIC FI	R.V.	54.993.398,16	1,79	0,56	227,38	7,19			-1,69	-3,29
FIC FIP Kinea Private Equity II	R.V.	14.005.985,59	-0,05	-5,75	-6,31	-74,41			-3,53	-9,60
Itaú Institucional Ações Phoenix	R.V.	26.363.966,92	-1,28	3,42	-162,95	44,23			-4,76	-0,43
Kinea Private Equity IV Feeder Instituc. I FIP Multiestrategia	R.V.	854.781,19	-12,28		-1.561,24				-15,76	
TOTAL		214.630.276,13								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	72.577.596,28	-0,17	2,66	-21,03	34,40	-35,35	55,24		
Santander FI IRF-M Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	20.661.974,27	1,28		162,86		273,75			
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	1.385.851,32	2,23	-0,28	283,43	-3,62			-1,25	-4,13
TOTAL		94.625.421,87								

GW CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.										
GW Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	128.306,56	6,23	-76,45	791,19	-989,45			2,75	-80,30
TOTAL		128.306,56								

BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual Carteira Administrada	R.F.	188.141.228,24	0,22	4,76	28,33	61,60	47,62	98,93		
BTG Pactual Timberland Fund I - FIQ de FIP	R.V.	1.800.952,87	2,64	0,75	335,82	9,75			-0,83	-3,10
BTG Pactual Absoluto Institucional FIQ de FIA	R.V.	5.072.458,83	2,19		278,96				-1,28	
TOTAL		195.014.639,94								

QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.										
Queluz Valor Fundo de Investimento em Ações	R.V.	2.329.117,90	1,31	-0,22	166,00	-2,89			-2,17	-4,07
TOTAL		2.329.117,90								

PATRIA INVESTIMENTOS LTDA.										
Patria Special Opportunities I - FIQ FIP	R.V.	6.919.860,21	-0,08	-0,48	-9,66	-6,24			-3,55	-4,33
P2 Brasil Infraestrutura III FIQ FIP	R.V.	4.474.370,89	11,43	23,88	1.452,37	309,07			7,95	20,03
TOTAL		11.394.231,10								

AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.										
AZ Quest Small Mid Caps FIC de FIA	R.V.	35.597.599,30	-0,59	0,12	-74,87	1,54			-4,06	-3,73
AZ Quest Ações FIC FI de Ações	R.V.	22.334.046,92	3,09		393,22				-0,38	
TOTAL		57.931.646,22								

BRZ INVESTIMENTOS LTDA.										
Terras Brasil - FIP	R.V.	2.577.235,92	-0,49	50,83	-62,36	657,88			-3,97	46,98
TOTAL		2.577.235,92								

ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA.										
Icatu Vanguarda Dividendos Fundo de Investimento em Ações	R.V.	7.434.255,92	0,50		63,18					-2,98
TOTAL		7.434.255,92								
BANCO SAFRA S/A										
Safra S&P Reais PB FI Multimercado	M.M.	17.325.703,49	0,47		60,36		101,5			
TOTAL		17.325.703,49								
TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO		2.789.601.596,30	DISPONIBILIDADE DAS APLICAÇÕES - SETEMBRO/2018 (28/09/2018)							

PLANO PREVIDENCIÁRIO										
CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Carteira Administrada Caixa Economica de TPF-NTN-B e NTN-F	R.F.	436.522.036,51	0,55	4,30	70,34	55,59	118,23	89,27		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	100.267.208,91	-0,13	2,87	-15,99	37,11	-26,88	59,60		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	7.140.504,71	0,86	4,79	108,89	61,93	183,04	99,46		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	67.982.623,02	0,44	4,65	56,49	60,24	94,96	96,74		
FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	571.618,88	-2,16	-10,91	-274,17	-141,24			-5,63	-14,76
TOTAL		612.483.992,03								
BANCO DO BRASIL S/A										
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	50.594.330,06	-0,17	2,75	-21,27	35,63	-35,75	57,22		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	8.552.893,99	0,89	6,33	112,67	81,97	189,40	131,63		
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	47.944.834,68	0,49	4,77	62,47	61,72	105,01	99,11		
BB Ações Cielo FI	R.V.	3.365.970,87	-14,94	-43,63	-1.899,27	-564,73			-18,42	-47,48
TOTAL		110.458.029,57								
GWI CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.										
GWI Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	370.228,59	6,23	-76,45	791,19	-989,45			2,75	-80,30
TOTAL		370.228,59								
BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual Absoluto Institucional FIQ de FI de Ações	R.V.	5.163.537,04	2,19	0,61	278,96	7,89			-1,28	-3,24
TOTAL		5.163.537,04								
BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	13.695.999,26	-0,17	2,39	-21,59	30,88	-36,28	49,59		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	7.549.745,20	0,62	4,19	78,89	54,25	132,61	87,12		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	17.649.195,60	-1,05	0,69	-133,56	8,92	-224,51	14,33		
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	13.201.222,54	3,47	6,40	440,62	82,83			-0,01	2,55
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	851.266,89	1,29	2,71	163,36	35,13			-2,19	-1,13
TOTAL		52.947.429,49								
ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	7.256.841,73	-0,18	2,51	-23,49	32,54	-39,48	52,26		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	7.062.849,73	0,85	4,66	108,63	60,28	182,59	96,81		
Itaú Institucional RF Alocação Dinâmica II RF FICFI	R.F.	7.407.351,43	0,42	5,31	53,03	68,67	89,14	110,27		
Itaú Institucional Ações Phoenix	R.V.	9.880.890,87	-1,28		-162,95				-4,76	
TOTAL		31.607.933,76								
BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	4.659.455,20	-0,17	2,66	-21,03	34,40	-35,35	55,24		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	823.485,64	2,23	-0,28	283,43	-3,62			-1,25	-4,13
TOTAL		5.482.940,84								
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.										
AZ Quest Small Mid Caps FIC de FIA	R.V.	12.432.389,14	-0,59	0,12	-74,87	1,54			-4,06	-3,73
AZ Quest Ações FIC FI de Ações	R.V.	14.510.269,54	3,09		393,22				-0,38	
TOTAL		26.942.658,68								
TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO		845.456.750,00	DISPONIBILIDADE DAS APLICAÇÕES - SETEMBRO/2018 (28/09/2018)							
TOTAL GERAL APLICADO - (R\$)		3.635.058.346,30	PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO							

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - SETEMBRO/2018 28/09/2018

PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	1.320.993.929,20	47,35%	-2.974.770,78
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.082.802.036,59	38,81%	3.543.061,00
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	356.777.025,18	12,79%	5.244.555,00
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	29.028.605,33	1,04%	215.239,90
SALDO EM CONTAS CORRENTES	56.113,86	0,00%	
TOTAIS	2.789.657.710,16	100,00%	6.028.085,12

PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	436.522.036,51	51,63%	2.408.940,91
FUNDOS DE RENDA FIXA	347.763.833,49	41,13%	367.950,93
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	61.170.880,00	7,24%	233.181,66
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO		0,00%	
SALDO EM CONTAS CORRENTES	2.057,09	0,00%	
TOTAIS	845.458.807,09	100,00%	3.010.073,50

CONSOLIDAÇÃO DOS PLANOS NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - SETEMBRO/2018			
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	1.757.515.965,71	48,35%	-565.829,87
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.430.565.870,08	39,35%	3.911.011,93
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	417.947.905,18	11,50%	5.477.736,66
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	29.028.605,33	0,80%	215.239,90
SALDO EM CONTAS CORRENTES	58.170,95	0,00%	
TOTAIS	3.635.116.517,25	100,00%	9.038.158,62

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/2018 (28/09/2018)					Qtde. de Aplicaç.	
INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	PF	PP
BANCO DO BRASIL S/A	1.434.816.522,65	52.002,35	1.434.868.525,00	39,47%	9	4
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	1.079.124.423,03	4.760,57	1.079.129.183,60	29,69%	10	5
BANCO BRADESCO S/A	448.159.266,66	1.507,70	448.160.774,36	12,33%	11	5
ITAU UNIBANCO S/A	246.238.209,89	0,00	246.238.209,89	6,77%	8	4
BANCO BTG PACTUAL	200.178.176,98	0,00	200.178.176,98	5,51%	3	1
BANCO SANTANDER S/A	100.108.362,71	-99,67	100.108.263,04	2,75%	3	2
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	84.874.304,90	0,00	84.874.304,90	2,33%	2	2
BANCO SAFRA S/A	17.325.703,49	0,00	17.325.703,49	0,48%	1	
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA	11.394.231,10	0,00	11.394.231,10	0,31%	2	
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA.	7.434.255,92	0,00	7.434.255,92	0,20%	1	
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	2.577.235,92	0,00	2.577.235,92	0,07%	1	
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.	2.329.117,90	0,00	2.329.117,90	0,06%	1	
GW CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.	498.535,15	0,00	498.535,15	0,01%	1	1
TOTAIS	3.635.058.346,30	58.170,95	3.635.116.517,25	99,92%	53	24

Em setembro de 2018, 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	SET/2018	2018	ÍNDICE	SET/2018	2018
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,79	7,73	C.D.I.	0,47	4,81
RENDA FIXA	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,79	7,73	C.D.I.	0,47	4,81
RENDA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,79	7,73	IBOVESPA	3,48	3,85
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,79	7,73	C.D.I.	0,47	4,81

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 2018, 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	19	29	3	53

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	10	0	24

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 2018 - (%)									Rentabilidade dos Principais Indicadores Financeiros do Mercado Brasileiro para Referência dos Investimentos em 2018 - (%)				
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-18	0,716781	0,716781	3,413365	3,413365	2,738906	2,738906	3,259581	3,259581	0,5834	1,3336	4,9485	3,4013	11,1393
fev-18	0,666792	1,388352	0,507527	3,938215	0,377102	3,126336	0,477706	3,752858	0,4659	0,5392	0,5566	0,5486	0,5192
mar-18	0,556665	1,952746	0,730137	4,697107	1,229202	4,393967	0,844035	4,628568	0,5325	1,6202	0,3821	0,9355	0,0140
abr-18	0,696735	2,663086	0,062500	4,762543	0,023165	4,418150	0,053485	4,684530	0,5175	0,4215	-0,6290	-0,1438	0,8785
mai-18	0,916666	3,604163	-2,688031	1,946494	-2,788759	1,506179	-2,711211	1,846311	0,5175	-1,5573	-4,6530	-3,1569	-10,8713
jun-18	1,916663	5,589905	-0,503357	1,433339	-0,134838	1,369311	-0,418371	1,420216	0,5175	0,4497	-1,0785	-0,3201	-5,1999
jul-18	0,736728	6,367816	2,485757	3,954725	2,115752	3,514033	2,399897	3,854196	0,5422	1,4765	3,1462	2,3153	8,8753
ago-18	0,486755	6,885567	-0,613081	3,317398	-0,584676	2,908812	-0,606367	3,224459	0,5669	-0,2556	-0,5205	-0,4477	-3,2099
set-18	0,786824	7,726568	0,216559	3,541142	0,357301	3,276507	0,249258	3,481754	0,4681	0,8855	-1,0342	-0,1494	3,4755
out-18													
nov-18													
dez-18													
Acumulado	7,726568		3,541142		3,276507		3,481754		4,8114	4,9807	0,8259	2,8821	3,8485

