

DEMONSTRATIVO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - DEZEMBRO/2017

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 2017	NO MÊS	NO ANO 2017	NO MÊS	NO ANO 2017
					0,75	8,18	0,54	9,95	6,16	26,86

PLANO FINANCEIRO

BANCO DO BRASIL S/A										
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)		32.211.686,29								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)		992.108.737,66								
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)	R.F.	38.467.864,40	0,78	12,62	104,00	154,30	143,96	126,83		
Carteira Administrada Banco do Brasil - Oper. Compr.-1 Dia		0,00								
Carteira Administrada Banco do Brasil - Oper. Compr.-Longa		39.387.785,80								
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	4.128.580,17	0,85	12,80	113,39	156,46	156,96	128,61		
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	5.701.695,58	0,58	10,08	78,05	123,22	108,04	101,29		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	13.328.463,49	1,02	14,91	136,91	182,27	189,51	149,82		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	24.586.129,47	6,04	23,86	809,42	291,64			-0,11	-3,00
Brasil Ações IBrX Indexado FIC FI	R.V.	10.860.675,74	6,22	24,45	832,35	298,90			0,06	-2,40
BB Ações Consumo FIC FI	R.V.	5.692.533,23	6,69	30,90	895,60	377,74			0,53	4,04
BB Ações Cielo FI	R.V.	22.038.126,82	3,09	3,46	413,18	42,27			-3,07	-23,40
BB Ações BB Seguridade FI em Ações	R.V.	20.595.182,22	5,84	4,91	781,74	59,96			-0,32	-21,95
TOTAL		1.209.107.460,87								
CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	135.178.864,80	0,52	9,94	70,11	121,51	97,05	99,88		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	133.285.916,05	0,82	12,36	110,21	151,08	152,56	124,18		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	24.663.924,89	0,87	12,38	116,34	151,35	161,03	124,41		
FIDC Casan Saneamento	R.F.	18.696.972,93	-1,36	-7,13	-181,62	-87,21	-251,40	-71,68		
Caixa Brasil IRF-M 1+ TP RF LP	R.F.	78.041.537,78	1,38	16,15	185,41	197,41	256,65	162,27		
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	19.372.029,77	6,27	27,04	839,80	330,53			0,11	0,18
Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS	R.V.	14.206.215,51	5,23	19,71	700,76	240,97			-0,92	-7,14
FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	7.147.671,48	7,19	49,07	962,59	599,84			1,03	22,21
Caixa FI Ações Institucional BDR Nivel I	R.V.	5.914.231,81	4,17	22,81	557,99	278,81			-1,99	-4,05
TOTAL		436.507.365,02								
BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	283.877.506,42	0,85	12,96	113,21	158,47	156,71	130,26		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	150.131.518,04	0,89	13,07	119,27	159,74	165,10	131,31		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	12.358.046,97	0,77	12,39	103,00	151,47	142,57	124,51		
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	14.832.294,26	5,77	30,88	773,03	377,44			-0,38	4,02
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	9.025.713,45	7,86	41,92	1.052,79	512,38			1,71	15,06
Bradesco H FI em Ações Ibovespa	R.V.	12.093.105,60	6,02	23,62	806,71	288,77			-0,13	-3,23
Bradesco H FI Ações Ibovespa Valuation	R.V.	4.700.325,21	5,38	33,15	719,74	405,20			-0,78	6,29
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	2.006.240,40	0,60	10,57	79,78	129,26	110,4	106,25		
TOTAL		489.024.750,35								
ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	105.162.671,66	0,79	12,29	106,18	150,26	146,98	123,51		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	16.148.270,42	0,85	12,14	113,99	148,36	157,78	121,95		
Itaú Institucional RF PRE LP FIC FI	R.F.	20.169.100,65	1,22	14,70	162,89	179,70	225,47	147,71		
Itaú Institucional RF Alocação Dinâmica II RF FICFI	R.F.	30.581.236,35	0,80	0,00	106,62	0,00	147,58	0,00		
Itaú FOF RPI Ações Ibovespa Ativo - FIC FI	R.V.	54.689.486,56	5,79	26,70	775,28	326,39			-0,37	-0,16
FIC FIP Kinea Private Equity II	R.V.	14.799.069,77	0,22	129,55	29,56	1.583,59			-5,94	102,69
Itaú Institucional Ações Phoenix	R.V.	4.864.328,52	5,71	0,00	764,00	0,00			-0,45	-26,86
Itaú Institucional Multimercado Juros e Moedas	M.M.	6.190.309,23	0,83	9,05	111,24	110,67	154,0	90,97		
TOTAL		252.604.473,16								
BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	116.600.428,22	0,81	12,59	108,35	153,95	149,98	126,55		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	1.389.737,10	4,24	20,60	568,20	251,86			-1,91	-6,25
TOTAL		117.990.165,32								
GW CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.										
GW Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	544.833,74	12,36	44,72	1.654,97	546,62			6,20	17,86
TOTAL		544.833,74								
BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual Carteira Administrada	R.F.	179.592.864,70	1,11	11,27	149,05	137,77	206,32	113,24		
BTG Pactual Timberland Fund I - FIQ de FIP	R.V.	1.510.854,99	0,77	-0,18	103,26	-2,24			-5,39	-27,04
TOTAL		181.103.719,69								
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.										
Geração Futuro Dividendos FIA	R.V.	2.679.949,66	1,78	-0,58	238,35	-7,08			-4,38	-27,44
TOTAL		2.679.949,66								
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.										
Queluz Valor Fundo de Investimento em Ações	R.V.	2.334.333,78	4,36	21,21	584,16	259,21			-1,79	-5,65
TOTAL		2.334.333,78								
PATRIA INVESTIMENTOS LTDA.										
Patria Special Opportunities I - FIQ FIP	R.V.	6.953.366,95	0,23	1,49	30,18	18,24			-5,93	-25,36
P2 Brasil Infraestrutura III FIQ FIP	R.V.	3.336.399,17	7,14	28,17	956,53	344,32			0,99	1,31
TOTAL		10.289.766,12								
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.										
AZ Quest Small Mid Caps FIC de FIA	R.V.	16.075.124,74	5,02	40,89	672,73	499,78			-1,13	14,03
TOTAL		16.075.124,74								
BRZ INVESTIMENTOS LTDA										
Terras Brasil - FIP	R.V.	1.708.686,33	-0,43	-5,06	-57,52	-61,80			-6,59	-31,91
TOTAL		1.708.686,33								
TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO		2.719.970.628,78								
										DISPONIBILIDADE DAS APLICAÇÕES EM 29/12/2017

PLANO PREVIDENCIÁRIO										
CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Carteira Administrada Caixa Economica de TPF-NTN-B e NTN-F	R.F.	426.404.865,03	0,96	13,90	128,18	169,86	177,43	139,62		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	90.632.162,44	0,82	12,36	110,21	151,08	152,56	124,18		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	6.814.408,60	0,87	12,38	116,34	151,35	161,03	124,41		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	64.197.326,27	0,52	9,94	70,11	121,51	97,05	99,88		
FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	641.640,68	7,19	49,07	962,59	599,84			1,03	22,21
TOTAL		588.690.403,02								
BANCO DO BRASIL S/A										
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	49.238.836,39	0,85	12,80	113,39	156,46	156,96	128,61		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	8.043.479,22	1,02	14,91	136,91	182,27	189,51	149,82		
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	19.038.087,08	0,58	10,08	78,05	123,22	108,04	101,29		
BB Ações Cielo FI	R.V.	12.970.366,38	3,09	3,46	413,18	42,27			-3,07	-23,40
BB Ações BB Seguridade FI em Ações	R.V.	5.083.341,07	5,84	4,91	781,74	59,96			-0,32	-21,95
TOTAL		94.374.110,14								
GWI CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.										
GWI Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.572.117,78	12,36	44,72	1.654,97	546,62			6,20	17,86
TOTAL		1.572.117,78								
BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual Absoluto Institucional FIQ de FI de Ações	R.V.	5.132.251,61	4,95	29,72	662,44	363,33			-1,21	2,87
TOTAL		5.132.251,61								
BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	19.676.905,36	0,85	12,96	113,21	158,47	156,71	130,26		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	8.690.860,27	0,89	13,07	119,27	159,74	165,10	131,31		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	25.339.247,06	0,77	12,39	103,00	151,47	142,57	124,51		
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	12.407.135,33	5,77	30,88	773,03	377,44			-0,38	4,02
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	828.772,31	7,86	41,92	1.052,79	512,38			1,71	15,06
TOTAL		66.942.920,73								
ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	13.380.009,11	0,79	12,29	106,18	150,26	146,98	123,51		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	6.748.511,71	0,85	12,14	113,99	148,36	157,78	121,95		
Itaú Institucional RF Alocação Dinâmica II RF FICFI	R.F.	7.034.157,19	0,80		106,62	0,00	147,58	0,00		
TOTAL		27.162.678,01								
BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	5.111.430,04	0,81	12,59	108,35	153,95	149,98	126,55		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	825.794,60	4,24	20,60	568,20	251,86			-1,91	-6,25
TOTAL		5.937.224,64								
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.										
AZ Quest Small Mid Caps FIC de FIA	R.V.	12.417.642,87	5,02	0,00	672,73	0,00			-1,13	-26,86
TOTAL		12.417.642,87								
TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO		802.229.348,80								DISPONIBILIDADE DAS APLICAÇÕES EM 29/12/2017
TOTAL GERAL APLICADO - (R\$)		3.522.199.977,58								PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 29/12/2017

PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	1.281.768.938,85	47,11%	10.560.259,23
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.148.054.734,42	42,20%	9.682.369,06
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	281.950.405,88	10,36%	13.690.629,87
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	8.196.549,63	0,30%	62.885,09
SALDO EM CONTAS CORRENTES	565.412,00	0,02%	
TOTAIS	2.720.536.040,78	100,00%	33.996.143,25

PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	426.404.865,03	53,15%	4.043.125,77
FUNDOS DE RENDA FIXA	323.945.421,14	40,38%	2.422.877,83
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	51.879.062,63	6,47%	2.491.744,94
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO		0,00%	
SALDO EM CONTAS CORRENTES	2.787,88	0,00%	
TOTAIS	802.232.136,68	100,00%	8.957.748,54

CONSOLIDAÇÃO DOS PLANOS NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - DEZEMBRO DE 2017			
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	1.708.173.803,88	48,49%	14.603.385,00
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.472.000.155,56	41,79%	12.105.246,89
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	333.829.468,51	9,48%	16.182.374,81
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	8.196.549,63	0,23%	62.885,09
SALDO EM CONTAS CORRENTES	568.199,88	0,02%	
TOTAIS	3.522.768.177,46	100,00%	42.953.891,79

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 - DEZEMBRO DE 2017					Qtde. de Aplicaç.	
INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	PF	PP
BANCO DO BRASIL S/A	1.303.481.571,01	81.383,81	1.303.562.954,82	37,00%	9	5
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	1.025.197.768,04	485.273,42	1.025.683.041,46	29,12%	9	5
BANCO BRADESCO S/A	555.967.671,08	1.542,16	555.969.213,24	15,78%	8	5
ITAU UNIBANCO S/A	279.767.151,17	0,00	279.767.151,17	7,94%	8	3
BANCO BTG PACTUAL	186.235.971,30	0,00	186.235.971,30	5,29%	2	1
BANCO SANTANDER S/A	123.927.389,96	0,49	123.927.390,45	3,52%	2	2
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	28.492.767,61	0,00	28.492.767,61	0,81%	1	1
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA	10.289.766,12	0,00	10.289.766,12	0,29%	2	
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.	2.679.949,66	0,00	2.679.949,66	0,08%	1	
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.	2.334.333,78	0,00	2.334.333,78	0,07%	1	
GWI CONSULT. PARTICIP. E SERV. LTDA.	2.116.951,52	0,00	2.116.951,52	0,06%	1	1
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	1.708.686,33	0,00	1.708.686,33	0,05%	1	
TOTAIS	3.522.199.977,58	568.199,88	3.522.768.177,46	100,00%	45	23

Em dezembro 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	DEZ/2017	2017	INDICE	DEZ/2017	2017
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,75	8,18	C.D.I.	0,54	9,95
RENTA FIXA	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,75	8,18	C.D.I.	0,54	9,95
RENTA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,75	8,18	IBOVESPA	6,16	26,86
RENTA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,75	8,18	C.D.I.	0,54	9,95

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 dezembro 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	25	2	45

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 EM COMPARAÇÃO COM A META ATUARIAL DE INPC + 6% a.a.

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)	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-17	0,906729	0,906729	1,975038	1,975038	1,524442	1,524442	1,874995	1,874995	1,0873	1,1564	2,2370	1,8668	7,3779
fev-17	0,726802	1,640121	3,226640	5,265406	3,116315	4,688263	3,202192	5,137227	0,8664	1,4921	5,0582	3,8491	3,0792
mar-17	0,806855	2,460210	0,904038	6,217046	1,267907	6,015613	0,984609	6,172418	1,0504	1,3909	0,8751	1,0448	-2,5172
abr-17	0,566725	3,040878	0,035112	6,254340	0,051904	6,070639	0,038846	6,213662	0,7889	0,7098	-0,8155	-0,3219	0,6451
mai-17	0,846834	3,913463	-0,995273	5,196820	-0,899174	5,116880	-0,973658	5,179504	0,9256	0,0843	-1,7760	-1,1882	-4,1157
jun-17	0,186835	4,107610	0,437474	5,657029	0,470895	5,611870	0,445010	5,647563	0,8117	0,5246	-0,0555	0,1645	0,3006
jul-17	0,656681	4,791264	3,682022	9,547344	3,593804	9,407353	3,662075	9,516456	0,8008	2,8464	4,6736	3,9976	4,8019
ago-17	0,456784	5,269934	1,476366	11,164663	1,413836	10,954194	1,462213	11,117821	0,8014	1,2546	1,3626	1,3428	7,4555
set-17	0,466768	5,761300	1,814207	13,181420	1,396008	12,503123	1,719427	13,028410	0,6414	1,0066	2,3987	1,8108	4,8824
out-17	0,856786	6,667448	-0,209919	12,943831	0,003258	12,506789	-0,161697	12,845646	0,6459	0,4839	-1,0112	-0,3818	0,0202
nov-17	0,666806	7,378713	-0,652110	12,207313	-0,442437	12,009017	-0,604534	12,163456	0,5675	0,1027	-1,3993	-0,7607	-3,1457
dez-17	0,746803	8,180620	1,265691	13,627511	1,129216	13,273841	1,234575	13,548198	0,5395	0,8837	0,7858	0,8282	6,1568
Acumulado	8,180620		13,627511		13,273841		13,548198		9,9522	12,5776	12,7501	12,7941	26,8563

