

**DEMONSTRATIVO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV**

**CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - JANEIRO/2018**

ALOCADAÇÃO 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 2018	NO MÊS	NO ANO 2018	NO MÊS	NO ANO 2018
					<b>0,72</b>	<b>0,72</b>	<b>0,58</b>	<b>0,58</b>	<b>11,14</b>	<b>11,14</b>

**PLANO FINANCEIRO**

<b>BANCO DO BRASIL S/A</b>										
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)		15.546.473,08								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)		1.044.688.658,57								
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)	R.F.	38.786.169,49	3,30	3,30	460,76	460,76	566,13	566,13		
Carteira Administrada Banco do Brasil - Oper. Compr.-1 Dia		39.659.089,43								
Carteira Administrada Banco do Brasil - Oper. Compr.-Longa		0,00								
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	4.266.761,96	3,35	3,35	466,94	466,94	573,73	573,73		
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	782.811,01	0,57	0,57	79,67	79,67	97,89	97,89		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	13.509.482,08	1,36	1,36	189,48	189,48	232,81	232,81		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	27.249.154,47	10,83	10,83	1.511,12	1.511,12			-0,31	-0,31
Brasil Ações IBrX Indexado FIC FI	R.V.	11.999.634,16	10,49	10,49	1.463,07	1.463,07			-0,65	-0,65
BB Ações Consumo FIC FI	R.V.	5.769.412,14	1,35	1,35	188,42	188,42			-9,79	-9,79
BB Ações Cielo FI	R.V.	25.134.024,56	14,05	14,05	1.959,86	1.959,86			2,91	2,91
BB Ações BB Seguridade FI em Ações	R.V.	22.444.431,17	8,98	8,98	1.252,69	1.252,69			-2,16	-2,16
<b>TOTAL</b>		<b>1.249.836.102,12</b>								

<b>CAIXA ECONOMICA FEDERAL</b>										
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	135.946.757,87	0,57	0,57	79,25	79,25	97,37	97,37		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	137.688.161,73	3,30	3,30	460,79	460,79	566,17	566,17		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	24.986.344,20	1,31	1,31	182,38	182,38	224,09	224,09		
FIDC Casan Saneamento	R.F.	18.485.865,75	-1,13	-1,13	-157,52	-157,52	-193,55	-193,55		
Caixa Brasil IRF-M 1+ TP RF LP	R.F.	79.334.209,81	1,66	1,66	231,09	231,09	283,93	283,93		
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	21.684.916,84	11,94	11,94	1.665,69	1.665,69			0,80	0,80
Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS	R.V.	15.017.794,65	5,71	5,71	797,01	797,01			-5,43	-5,43
FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	7.474.365,13	4,57	4,57	637,66	637,66			-6,57	-6,57
Caixa FI Ações Institucional BDR Nivel I	R.V.	6.006.353,07	1,56	1,56	217,31	217,31			-9,58	-9,58
<b>TOTAL</b>		<b>446.624.769,05</b>								

<b>BANCO BRADESCO S/A</b>										
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	293.487.300,16	3,39	3,39	472,28	472,28	580,28	580,28		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	152.851.668,58	1,81	1,81	252,78	252,78	310,58	310,58		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	12.960.811,39	4,88	4,88	680,47	680,47	836,09	836,09		
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	16.511.309,92	11,32	11,32	1.579,28	1.579,28			0,18	0,18
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	9.549.484,74	5,80	5,80	809,61	809,61			-5,34	-5,34
Bradesco H FI em Ações Ibovespa	R.V.	13.407.146,23	10,87	10,87	1.515,95	1.515,95			-0,27	-0,27
Bradesco H FI Ações Ibovespa Valuation	R.V.	5.294.791,01	12,65	12,65	1.764,47	1.764,47			1,51	1,51
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	2.018.625,10	0,62	0,62	86,12	86,12	105,8	105,82		
<b>TOTAL</b>		<b>506.081.137,13</b>								

<b>ITAU UNIBANCO S/A</b>										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	108.692.271,05	3,36	3,36	468,25	468,25	575,33	575,33		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	16.357.706,68	1,30	1,30	180,94	180,94	222,32	222,32		
Itaú Institucional RF PRE LP FIC FI	R.F.	20.383.937,45	1,26	1,26	176,10	176,10	216,37	216,37		
Itaú Institucional RF Alocação Dinâmica II RF FICFI	R.F.	31.035.602,28	1,49	1,49	207,28	207,28	254,69	254,69		
Itaú FOF RPI Ações Ibovespa Ativo - FIC FI	R.V.	60.001.567,34	9,71	9,71	1.355,11	1.355,11			-1,43	-1,43
FIC FIP Kinea Private Equity II	R.V.	13.041.587,75	-11,88	-11,88	-1.656,80	-1.656,80			-23,01	-23,01
Itaú Institucional Ações Phoenix	R.V.	6.828.566,40	7,74	7,74	1.080,04	1.080,04			-3,40	-3,40
Itaú Institucional Multimercado Juros e Moedas	M.M.	6.226.463,71	0,58	0,58	81,48	81,48	100,1	100,12		
<b>TOTAL</b>		<b>262.567.702,66</b>								

<b>BANCO SANTANDER S/A</b>										
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	120.538.074,73	3,38	3,38	471,14	471,14	578,88	578,88		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	1.522.835,87	9,58	9,58	1.336,15	1.336,15			-1,56	-1,56
<b>TOTAL</b>		<b>122.060.910,60</b>								

<b>GWJ CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.</b>										
GWJ Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	280.604,70	-48,50	-48,50	-6.765,97	-6.765,97			-59,64	-59,64
<b>TOTAL</b>		<b>280.604,70</b>								

<b>BANCO BTG PACTUAL</b>										
BTG Pactual Carteira Administrada	R.F.	182.398.981,93	1,56	1,56	217,99	217,99	267,84	267,84		
BTG Pactual Timberland Fund I - FIQ de FIP	R.V.	1.502.259,83	-0,57	-0,57	-79,37	-79,37			-11,71	-11,71
<b>TOTAL</b>		<b>183.901.241,82</b>								

<b>GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.</b>										
Geração Futuro Dividendos FIA	R.V.	2.937.018,41	9,59	9,59	1.338,25	1.338,25			-1,55	-1,55
<b>TOTAL</b>		<b>2.937.018,41</b>								

<b>QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.</b>										
Queluz Valor Fundo de Investimento em Ações	R.V.	2.513.095,88	7,66	7,66	1.068,38	1.068,38			-3,48	-3,48
<b>TOTAL</b>		<b>2.513.095,88</b>								

<b>PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA.</b>										
Pátria Special Opportunities I - FIQ FIP	R.V.	6.946.989,22	-0,09	-0,09	-12,80	-12,80			-11,23	-11,23
P2 Brasil Infraestrutura III FIQ FIP	R.V.	3.378.864,03	0,00	0,00	0,37	0,37			-11,14	-11,14
<b>TOTAL</b>		<b>10.325.853,25</b>								

<b>AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.</b>										
AZ Quest Small Mid Caps FIC de FIA	R.V.	17.556.652,54	9,22	9,22	1.285,79	1.285,79			-1,92	-1,92
<b>TOTAL</b>		<b>17.556.652,54</b>								

<b>BRZ INVESTIMENTOS LTDA</b>										
Terras Brasil - FIP	R.V.	3.498.850,80	104,77	104,77	14.616,53	14.616,53			93,63	93,63
<b>TOTAL</b>		<b>3.498.850,80</b>								

<b>TOTAL APLICADA DO PLANO FINANCEIRO</b>		<b>2.808.183.938,96</b>								
					<b>DISPONIBILIDADE DAS APLICAÇÕES EM 31/01/2018</b>					

PLANO PREVIDENCIÁRIO										
<b>CAIXA ECONOMICA FEDERAL</b>										
Carteira Administrada Caixa Economica de TPF-NTN-B e NTN-F	R.F.	435.028.828,34	2,15	2,15	299,61	299,61	368,13	368,13		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	93.625.614,90	3,30	3,30	460,79	460,79	566,17	566,17		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	6.903.490,00	1,31	1,31	182,38	182,38	224,09	224,09		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	65.054.874,37	0,57	0,57	79,25	79,25	97,37	97,37		
FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	670.967,70	4,57	4,57	637,66	637,66			-6,57	-6,57
<b>TOTAL</b>		<b>601.283.775,31</b>								
<b>BANCO DO BRASIL S/A</b>										
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	50.886.838,93	3,35	3,35	466,94	466,94	573,73	573,73		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	8.152.720,56	1,36	1,36	189,48	189,48	232,81	232,81		
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	18.632.297,27	0,57	0,57	79,67	79,67	97,89	97,89		
BB Ações Cielo FI	R.V.	14.792.432,67	14,05	14,05	1.959,86	1.959,86			2,91	2,91
BB Ações BB Seguridade FI em Ações	R.V.	5.539.776,13	8,98	8,98	1.252,69	1.252,69			-2,16	-2,16
<b>TOTAL</b>		<b>98.004.065,56</b>								
<b>GW CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.</b>										
GW Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	809.684,87	-48,50	-48,50	-6.765,97	-6.765,97				-59,64
<b>TOTAL</b>		<b>809.684,87</b>								
<b>BANCO BTG PACTUAL</b>										
BTG Pactual Absoluto Institucional FIQ de FI de Ações	R.V.	5.531.986,87	7,79	7,79	1.086,62	1.086,62				-3,35
<b>TOTAL</b>		<b>5.531.986,87</b>								
<b>BANCO BRADESCO S/A</b>										
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	20.343.006,05	3,39	3,39	472,28	472,28	580,28	580,28		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	8.848.325,61	1,81	1,81	252,78	252,78	310,58	310,58		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	26.575.170,23	4,88	4,88	680,47	680,47	836,09	836,09		
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	13.811.623,00	11,32	11,32	1.579,28	1.579,28			0,18	0,18
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	876.866,81	5,80	5,80	809,61	809,61			-5,34	-5,34
<b>TOTAL</b>		<b>70.454.991,70</b>								
<b>ITAU UNIBANCO S/A</b>										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	13.829.085,43	3,36	3,36	468,25	468,25	575,33	575,33		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	6.836.037,06	1,30	1,30	180,94	180,94	222,32	222,32		
Itaú Institucional RF Alocação Dinâmica II RF FICFI	R.F.	7.138.668,38	1,49	1,49	207,28	207,28	254,69	254,69		
<b>TOTAL</b>		<b>27.803.790,93</b>								
<b>BANCO SANTANDER S/A</b>										
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	5.284.045,23	3,38	3,38	471,14	471,14	578,88	578,88		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	904.883,12	9,58	9,58	1.336,15	1.336,15			-1,56	-1,56
<b>TOTAL</b>		<b>6.188.928,35</b>								
<b>AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.</b>										
AZ Quest Small Mid Caps FIC de FIA	R.V.	13.562.087,05	9,22	9,22	1.285,79	1.285,79				-1,92
<b>TOTAL</b>		<b>13.562.087,05</b>								
<b>TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO</b>		<b>823.639.310,64</b>								<b>DISPONIBILIDADE DAS APLICAÇÕES EM 31/01/2018</b>
<b>TOTAL GERAL APLICADO - (R\$)</b>		<b>3.631.823.249,60</b>								<b>PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO</b>

### RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 31/01/2018

PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	1.321.079.372,50	46,98%	39.308.790,11
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.171.307.766,73	41,66%	28.693.613,42
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	307.551.710,92	10,94%	25.845.009,38
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	8.245.088,81	0,29%	48.539,18
SALDO EM CONTAS CORRENTES	3.715.018,59	0,13%	
<b>TOTAIS</b>	<b>2.811.898.957,55</b>	<b>100,00%</b>	<b>93.895.952,09</b>

PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	435.028.828,34	52,74%	9.148.121,55
FUNDOS DE RENDA FIXA	332.110.174,08	40,26%	8.187.945,45
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	56.500.308,22	6,85%	4.621.245,59
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO		0,00%	
SALDO EM CONTAS CORRENTES	1.238.415,27	0,15%	
<b>TOTAIS</b>	<b>824.877.725,91</b>	<b>100,00%</b>	<b>21.957.312,59</b>

CONSOLIDAÇÃO DOS PLANOS NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - JANEIRO DE 2018			
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	1.756.108.200,84	48,29%	48.456.911,66
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.503.417.940,81	41,34%	36.881.558,87
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	364.052.019,14	10,01%	30.466.254,97
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	8.245.088,81	0,23%	48.539,18
SALDO EM CONTAS CORRENTES	4.953.433,86	0,14%	
<b>TOTAIS</b>	<b>3.636.776.683,46</b>	<b>100,00%</b>	<b>115.853.264,68</b>

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 - JANEIRO DE 2018					Qtde. de Aplicaç.	
INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	PF	PP
BANCO DO BRASIL S/A	1.347.840.167,68	4.740.462,26	1.352.580.629,94	37,19%	9	5
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	1.047.908.544,36	211.428,95	1.048.119.973,31	28,82%	9	5
BANCO BRADESCO S/A	576.536.128,83	1.542,16	576.537.670,99	15,85%	8	5
ITAU UNIBANCO S/A	290.371.493,59	0,00	290.371.493,59	7,98%	8	3
BANCO BTG PACTUAL	189.433.228,69	0,00	189.433.228,69	5,21%	2	1
BANCO SANTANDER S/A	128.249.838,95	0,49	128.249.839,44	3,53%	2	2
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	31.118.739,59	0,00	31.118.739,59	0,86%	1	1
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA	10.325.853,25	0,00	10.325.853,25	0,28%	2	
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.	2.937.018,41	0,00	2.937.018,41	0,08%	1	
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.	2.513.095,88	0,00	2.513.095,88	0,07%	1	
GWI CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.	1.090.289,57	0,00	1.090.289,57	0,03%	1	1
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	3.498.850,80	0,00	3.498.850,80	0,10%	1	
<b>TOTAIS</b>	<b>3.631.823.249,60</b>	<b>4.953.433,86</b>	<b>3.636.776.683,46</b>	<b>100,00%</b>	<b>45</b>	<b>23</b>

Em janeiro de 2018, 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	JAN/2018	2018	INDICE	JAN/2018	2018
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,72	0,72	C.D.I.	0,58	0,58
RENTA FIXA	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,72	0,72	C.D.I.	0,58	0,58
RENTA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,72	0,72	IBOVESPA	11,14	11,14
RENTA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,72	0,72	C.D.I.	0,58	0,58

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 janeiro 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	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 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	3,459322	3,459322	2,738906	2,738906	3,295058	3,295058	0,5834	1,3336	4,9485	3,4013	11,1393
fev-18													
mar-18													
abr-18													
mai-18													
jun-18													
jul-18													
ago-18													
set-18													
out-18													
nov-18													
dez-18													
Acumulado	0,716781		3,459322		2,738906		3,295058		0,5834	1,3336	4,9485	3,4013	11,1393

**GRÁFICO DE RENTABILIDADE ACUMULADA EM 2018 - %**  
**CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV EM COMPARAÇÃO COM A META ATUARIAL DE INPC + 6%A.A.**

