



AMAPÁ PREVIDÊNCIA
DIRETORIA FINANCEIRA E ATUARIAL
DIVISÃO DE CONTROLE ATUARIAL E MERCADO

RELATORIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - ABRIL DE 2011

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO	SEGMENTO	VALOR R\$	RENDIMENTO DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
			NO MÊS	NO ANO 2011	META ATUARIAL		META GERENCIAL			
					INPC + 6%a.a.		CDI		IBOVESPA	
					NO MÊS	NO ANO 2011	NO MÊS	NO ANO 2011	NO MÊS	NO ANO 2011
				1,21	4,85	0,84	3,50	-3,58	-4,58	

PLANO FINANCEIRO

BANCO DO BRASIL S/A										
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)		31.495.232,79								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	295.326.535,25	0,53	3,14	44,01	64,78	63,39	89,76		
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)		0,00								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-F (PRE)		2.970.556,76								
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	39.039.031,54	0,51	2,37	42,55	48,83	61,29	67,66		
FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F - CAESB	R.F.	21.259.366,09	1,10	4,65	91,14	95,89	131,26	132,87		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	32.819.314,41	(3,89)	(6,76)	(322,73)	(139,39)			(0,32)	(2,19)
Brasil Ações IBrX Indexado FIC FI	R.V.	8.919.383,36	(4,15)	(5,39)	(343,94)	(111,04)			(0,57)	(0,81)
TOTAL		431.829.420,20								

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Caixa FI em Ações Ibovespa Ativo	R.V.	3.934.777,16	(3,47)	(6,40)	(287,27)	(131,85)			0,11	(1,82)
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	18.899.793,01	(3,75)	(5,03)	(311,02)	(103,66)			(0,18)	(0,45)
TOTAL		22.834.570,17								

BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	93.399.294,76	0,53	2,38	44,29	49,04	63,80	67,96		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	53.742.688,57	0,85	3,24	70,70	66,71	101,83	92,44		
Bradesco FIC FI em Ações Ibovespa Indexado	R.V.	16.517.607,98	(3,91)	(5,88)	(324,03)	(121,26)			(0,33)	(1,31)
Bradesco FIC FI Multimercado Golden Profit Moderado	M.M.	2.340.219,51	(0,41)	0,66	(34,01)	13,71	(48,98)	18,99		
TOTAL		165.999.810,82								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	50.646.638,54	0,52	2,31	43,03	47,65	61,97	66,03		
Unibanco Private Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	2.809.211,21	(3,82)	(5,54)	(316,31)	(114,28)			(0,24)	(0,97)
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	27.146.296,73	(1,30)	(1,48)	(108,08)	(30,48)			2,27	3,10
Unibanco Equity Hedge FI Multimercado	M.M.	5.546,11	0,88	4,25	72,54	87,65	104,47	121,45		
TOTAL		80.607.692,59								

BANCO HSBC BANK BRASIL S/A										
Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo	R.F.	58.959.071,67	0,77	3,35	63,72	69,12	91,77	95,77		
Hsbc FI em Ações Ibovespa Top	R.V.	27.311.608,36	(3,75)	(5,28)	(310,68)	(108,91)			(0,17)	(0,71)
Hsbc FI Ações Setorial Ativo	R.V.	4.364.832,93	(3,87)	(5,71)	(320,50)	(117,73)			(0,29)	(1,13)
TOTAL		90.635.512,96								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	31.293.569,40	0,65	2,25	53,81	46,42	77,50	64,32		
TOTAL		31.293.569,40								

BANCO PANAMERICANO S/A										
Master Panamericano FIDC CDC Veículos	R.F.	13.624.777,99	0,94	3,93	77,80	81,00	112,06	112,23		
TOTAL		13.624.777,99								

SCHRODERS INVESTIMENT										
Schroder Previdenciário FI em Ações IBrX-50	R.V.	41.653.487,17	(3,51)	(4,74)	(290,65)	(97,62)			0,07	(0,16)
TOTAL		41.653.487,17								

GWI CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.										
GWI Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	2.246.318,28	0,76	1,35	62,95	27,74			4,34	5,92
TOTAL		2.246.318,28								

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.										
BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.513.369,76	(3,27)	(3,94)	(270,63)	(81,21)			0,31	0,64
TOTAL		2.513.369,76								

BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A										
FIDC Aberto BCSul Verax CPP360	R.F.	48.024.178,79	0,94	3,93	77,80	81,00	112,06	112,23		
FIDC Fechado BCSul Verax Multicred Financeiro	R.F.	31.712.879,09	1,47	5,44	121,81	112,16	175,44	155,42		
TOTAL		79.737.057,88								

TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO 962.975.587,22 DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 29/04/2011

PLANO PREVIDENCIÁRIO

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	144.921.591,85	0,91	4,80	75,41	99,00	108,61	137,19		
Caixa FI Novo Brasil RF Crédito Privado LP	R.F.	24.222.617,82	0,59	2,67	48,75	55,00	70,22	76,21		
TOTAL		169.144.209,67								

BANCO DO BRASIL S/A										
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	15.193.772,23	0,51	2,37	42,55	48,83	61,29	67,66		
TOTAL		15.193.772,23								

TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO 184.337.981,90 DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 29/04/2011

TOTAL GERAL APLICADO - (R\$) 1.147.313.569,12 PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 29/04/2011

PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	329.792.324,80	33,95%	1.767.106,17
FUNDOS DE RENDA FIXA	441.701.496,44	45,47%	3.253.439,57
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	189.136.000,36	19,47%	(6.576.239,99)
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	2.345.765,62	0,24%	(9.594,93)
SALDO EM CONTAS CORRENTES	8.470.141,19	0,87%	
TOTAIS	971.445.728,41	100,00%	(1.565.289,18)

PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	144.921.591,85	78,62%	1.309.446,02
FUNDOS DE RENDA FIXA	39.416.390,05	21,38%	205.935,44
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	0,00	0,00%	0,00
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	0,00	0,00%	0,00
SALDO EM CONTAS CORRENTES	2.730,87	0,00%	
TOTAIS	184.340.712,77	100,00%	1.515.381,46

CONSOLIDAÇÃO DOS PLANOS NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - ABRIL DE 2011			
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	474.713.916,65	41,07%	3.076.552,19
FUNDOS DE RENDA FIXA	481.117.886,49	41,63%	3.459.375,01
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	189.136.000,36	16,36%	(6.576.239,99)
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	2.345.765,62	0,20%	(9.594,93)
SALDO EM CONTAS CORRENTES	8.472.872,06	0,73%	
TOTAIS	1.155.786.441,18	100,00%	(49.907,72)

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 - ABRIL DE 2011					
INSTITUIÇÃO	FUNDO	CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL S/A	447.023.192,43	8.217.682,19	455.240.874,62	39,39%	5
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	191.978.779,84	1.256,28	191.980.036,12	16,61%	4
BANCO BRADESCO S/A	165.999.810,82	249.172,19	166.248.983,01	14,38%	4
ITAU UNIBANCO S/A	80.607.692,59	742,44	80.608.435,03	6,97%	4
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	90.635.512,96	4.018,96	90.639.531,92	7,84%	3
BANCO SANTANDER S/A	31.293.569,40	0,00	31.293.569,40	2,71%	1
BANCO PANAMERICANO S/A	13.624.777,99	0,00	13.624.777,99	1,18%	1
SCHRODERS INVESTIMENT	41.653.487,17	0,00	41.653.487,17	3,60%	1
GWI CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.	2.246.318,28	0,00	2.246.318,28	0,19%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.513.369,76	0,00	2.513.369,76	0,22%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A	79.737.057,88	0,00	79.737.057,88	6,90%	2
TOTAIS	1.147.313.569,12	8.472.872,06	1.155.786.441,18	100,00%	27

Em abril de 2011, os índices para atingimento das metas, atuarial e gerencial, são os seguintes:

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	ÍNDICE	ABR/11	2011	ÍNDICE	ABR/11	2011
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IGBE) + 6%	1,21	4,85	C.D.I.	0,84	3,50
RENDA FIXA	INPC(IGBE) + 6%	1,21	4,85	C.D.I.	0,84	3,50
RENDA VARIÁVEL	INPC(IGBE) + 6%	1,21	4,85	IBOVESPA	-3,58	-4,58
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IGBE) + 6%	1,21	4,85	C.D.I.	0,84	3,50

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 abril de 2011, distribuídos em 02 (duas) Carteira de Administradas de Títulos Públicos Federais e 25 (vinte e cinco) Fundos de Investimentos, sendo estes últimos distribuídos em 11 (onze) fundos de renda fixa, 12 (doze) fundos de renda variável e 02 (dois) fundos multimercado.