

RELATORIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - AGOSTO DE 2011

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO	SEGMENTO	VALOR R\$	RENDIMENTO DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
					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	NO MÊS	NO ANO 2011

PLANO FINANCEIRO

BANCO DO BRASIL S/A										
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)		41.483.200,67								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	316.612.987,86	5,53	11,95	609,99	147,56	515,80	155,71		
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)		0,00								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-F (PRE)		0,00								
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	35.114.535,40	5,02	9,37	554,10	115,68	468,53	122,06		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	568.920,09	1,00	3,75	110,70	46,35	93,60	48,91		
FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F - CAESB	R.F.	19.567.934,19	1,32	9,85	145,57	121,63	123,09	128,34		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	21.122.775,40	(4,03)	(21,01)	(444,33)	(259,41)			(0,07)	(2,53)
Brasil Ações IBrX Indexado FIC FI	R.V.	7.678.899,32	(4,61)	(18,55)	(508,39)	(228,93)			(0,65)	(0,06)
TOTAL		442.149.252,93								

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
FI Caixa Brasil IPCA XI Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	12.943.000,00	1,58	0,00	174,66	0,00	147,69	0,00		
FI Caixa Brasil IPCA XII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	12.950.162,50	1,63	0,00	180,19	0,00	152,36	0,00		
FI Caixa Brasil IPCA XIII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	12.687.312,50	1,30	0,00	143,17	0,00	121,06	0,00		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	6.227.566,80	1,08	7,79	119,19	96,22	100,78	101,53		
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	14.629.573,42	(5,82)	(19,69)	(641,37)	(243,05)			(1,86)	(1,21)
TOTAL		59.437.615,22								

BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	105.964.587,13	5,14	9,60	566,41	118,50	478,94	125,04		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	68.413.285,89	2,98	9,08	328,62	112,06	277,88	118,24		
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.	14.546.296,32	(0,25)	(6,23)	(28,12)	(76,87)			3,70	12,26
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	2.397.286,51	1,27	7,92	139,54	97,81	118,0	103,21		
Bradesco FIC FI Multimercado Golden Profit Moderado	M.M.	383,43	(0,20)	(0,76)	(22,49)	(9,39)	(19,01)	(9,91)		
TOTAL		191.321.839,28								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	54.933.084,17	5,37	9,69	591,73	119,60	500,35	126,20		
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	28.713.968,62	(3,95)	(12,67)	(435,30)	(156,39)			0,01	5,81
Unibanco Equity Hedge FI Multimercado	M.M.	5.691,05	0,08	6,98	8,46	86,12	7,15	90,87		
TOTAL		83.652.743,84								

BANCO HSBC BANK BRASIL S/A										
Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo	R.F.	79.346.243,14	2,97	9,49	327,34	117,10	276,79	123,56		
Hsbc FI em Ações Ibovespa Top	R.V.	21.482.919,36	(3,83)	(19,29)	(422,33)	(238,13)			0,13	(0,81)
Hsbc FI Ações Setorial Ativo	R.V.	3.773.086,74	(3,63)	(18,49)	(399,81)	(228,30)			0,33	(0,01)
TOTAL		104.602.249,24								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	38.944.775,44	5,37	9,75	591,74	120,34	500,36	126,98		
TOTAL		38.944.775,44								

BANCO PANAMERICANO S/A										
Caixa FIDC Master CDC Veículos do Banco Panamericano	R.F.	14.241.936,10	1,20	8,64	132,54	106,62	112,08	112,50		
TOTAL		14.241.936,10								

SCHROEDERS INVESTIMENT										
Schroder FI em Ações IBrX-50	R.V.	28.517.230,43	(6,18)	(19,77)	(681,39)	(244,06)			(2,22)	(1,29)
TOTAL		28.517.230,43								

GW CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.										
GW Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.757.623,03	(16,35)	(20,70)	(1.803,21)	(255,55)			(12,39)	(2,22)
TOTAL		1.757.623,03								

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.										
BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.154.139,45	(3,71)	(17,67)	(408,93)	(218,11)			0,25	0,81
TOTAL		2.154.139,45								

BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A										
FIDC Aberto BCSul Verax CPP360	R.F.	50.199.516,29	1,20	8,64	132,54	106,62	112,08	112,50		
FIDC Fechado BCSul Verax Multicred Financeiro	R.F.	32.931.975,42	0,99	9,49	109,21	117,20	92,34	123,67		
TOTAL		83.131.491,71								

BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual Institucional Dividendos FI em Ações	R.V.	12.505.535,39	(0,17)	2,11	(18,71)	26,04			3,79	20,59
TOTAL		12.505.535,39								

TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO		1.062.416.432,06								DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 31/08/2011
---	--	-------------------------	--	--	--	--	--	--	--	---

PLANO PREVIDENCIÁRIO

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	147.777.307,33	0,99	8,42	109,40	103,92	92,51	109,66		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	31.800.809,58	5,62	10,69	619,88	131,97	524,15	139,25		
FI Caixa Brasil IPCA XV Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	4.316.607,15	0,35	0,00	38,12	0,00	32,24	0,00		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	327.731,12	3,61	10,80	398,14	133,33	336,66	140,69		
TOTAL		184.222.455,18								

BANCO DO BRASIL S/A										
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	16.849.159,69	5,02	9,37	554,10	115,68	468,53	122,06		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	0,00	1,00	3,75	110,70	46,35	93,60	48,91		
TOTAL		16.849.159,69								



GWI CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.										
GWI Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.225.810,47	(16,35)	(20,70)	(1.803,21)	(255,55)			(12,39)	(2,22)
TOTAL		1.225.810,47								

BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A										
FIDC Aberto CPP540 RPPS	R.F.	3.642.288,63	0,95	9,40	104,44	116,01	88,31	122,41		
TOTAL		3.642.288,63								

TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO 205.939.713,97 DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 31/08/2011

TOTAL GERAL APLICADO - (R\$) 1.268.356.146,03 PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 31/08/2011

PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	358.096.188,53	33,45%	18.798.926,43
FUNDOS DE RENDA FIXA	545.034.835,06	50,91%	17.912.693,93
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	156.882.047,48	14,65%	(6.377.135,47)
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	2.403.360,99	0,22%	29.956,19
SALDO EM CONTAS CORRENTES	8.178.973,16	0,76%	
TOTAIS	1.070.595.405,22	100,00%	30.364.441,08

PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	147.777.307,33	71,76%	3.113.301,14
FUNDOS DE RENDA FIXA	56.936.596,17	27,65%	2.550.429,91
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	1.225.810,47	0,60%	(239.606,48)
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	0,00	0,00%	0,00
SALDO EM CONTAS CORRENTES	984,39	0,00%	
TOTAIS	205.940.698,36	100,00%	5.424.124,57

**CONSOLIDAÇÃO DOS PLANOS NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - AGOSTO DE 2011
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO**

DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	505.873.495,86	39,63%	21.912.227,57
FUNDOS DE RENDA FIXA	601.971.431,23	47,16%	20.463.123,84
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	158.107.857,95	12,39%	(6.616.741,95)
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	2.403.360,99	0,19%	29.956,19
SALDO EM CONTAS CORRENTES	8.179.957,55	0,64%	
TOTAIS	1.276.536.103,58	100,00%	35.788.565,65

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 - AGOSTO DE 2011

INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL S/A	458.998.412,62	8.169.069,01	467.167.481,63	36,60%	6
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	243.660.070,40	1.256,22	243.661.326,62	19,09%	9
BANCO BRADESCO S/A	191.321.839,28	4.973,72	191.326.813,00	14,99%	5
ITAU UNIBANCO S/A	83.652.743,84	739,94	83.653.483,78	6,55%	3
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	104.602.249,24	3.918,66	104.606.167,90	8,19%	3
BANCO SANTANDER S/A	38.944.775,44	0,00	38.944.775,44	3,05%	1
BANCO PANAMERICANO S/A	14.241.936,10	0,00	14.241.936,10	1,12%	1
SCHRODERS INVESTIMENT	28.517.230,43	0,00	28.517.230,43	2,23%	1
GWI CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.	2.983.433,50	0,00	2.983.433,50	0,23%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.154.139,45	0,00	2.154.139,45	0,17%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A	86.773.780,34	0,00	86.773.780,34	6,80%	3
BANCO BTG PACTUAL	12.505.535,39	0,00	12.505.535,39	0,98%	1
TOTAIS	1.268.356.146,03	8.179.957,55	1.276.536.103,58	100,00%	35

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

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	INDICE	AGO/11	2011	INDICE	AGO/11	2011
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,91	8,10	C.D.I.	1,07	7,68
RENDA FIXA	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,91	8,10	C.D.I.	1,07	7,68
RENDA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,91	8,10	IBOVESPA	-3,96	-18,48
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,91	8,10	C.D.I.	1,07	7,68

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 agosto de 2011, distribuídos em 02 (duas) Carteira de Administradas de Títulos Públicos Federais e 33 (trinta e três) Fundos de Investimentos, sendo estes últimos distribuídos em 19 (dezoito) fundos de renda fixa, 11 (onze) fundos de renda variável e 03 (três) fundos multimercado.