

**RELATORIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV**

**CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - DEZEMBRO 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	0,91	11,59	-0,21	-18,11
				MÊS	2011	MÊS	2011	MÊS	2011	

**PLANO FINANCEIRO**

<b>BANCO DO BRASIL S/A</b>										
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)	R.F.	43.997.050,92	0,27	16,76	27,55	135,06	30,30	144,59		
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	329.605.490,09								
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	24.507.640,77	0,36	14,56	36,25	117,26	39,87	125,54		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	3.400.206,47	0,84	7,27	84,04	58,58	92,42	62,71		
FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F. - CAESB	R.F.	18.687.685,73	1,14	14,84	114,37	119,52	125,76	127,95		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	20.870.424,01	(0,66)	(21,96)	(66,19)	(176,91)			(0,45)	(3,85)
Brasil Ações IBrX Indexado FIC FI	R.V.	7.833.560,82	1,03	(16,90)	103,28	(136,19)			1,24	1,20
<b>TOTAL</b>		<b>448.902.058,81</b>								

<b>CAIXA ECONOMICA FEDERAL</b>										
FI Caixa Brasil IPCA XI Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	14.309.037,50	2,21	14,47	221,89	116,60	243,98	124,82		
FI Caixa Brasil IPCA XII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	14.308.637,50	2,20	14,47	220,73	116,57	242,71	124,79		
FI Caixa Brasil IPCA XIII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	13.966.750,00	2,21	11,73	221,81	94,53	243,90	101,20		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	56.118,67	0,93	11,77	93,12	94,84	102,40	101,53		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	37.219.359,71	0,41	15,95	40,90	128,48	44,98	137,54		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	2.931.792,10	0,13	15,11	12,55	121,71	13,80	130,30		
FIDC da Companhia Estadual de Águas e Esgotos-CEDAE	R.F.	3.710.661,05	0,29	0,29	28,91	2,32	31,79	2,49		
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	15.046.918,57	0,86	(17,40)	86,78	(140,17)			1,08	0,71
FI Caixa Brasil IPCA V Multimercado Crédito Privado	M.M.	12.864.437,50	1,91	2,92	191,88	23,49	210,99	25,15		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	4.733.211,40	1,89	2,90	190,11	23,33	209,04	24,98		
FI Caixa Brasil IPCA VIII Multimercado Crédito Privado	M.M.	4.273.278,49	1,03	1,17	103,76	9,41	114,10	10,07		
<b>TOTAL</b>		<b>123.420.202,49</b>								

<b>BANCO BRADESCO S/A</b>										
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	116.192.302,84	0,38	14,85	38,57	119,60	42,41	128,04		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	72.049.417,89	0,45	13,89	45,31	111,93	49,83	119,82		
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.	14.126.932,22	1,95	(8,93)	195,86	(71,95)			2,16	9,18
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	2.484.980,17	0,83	11,87	83,01	95,64	91,3	102,39		
Bradesco FIC FI Multimercado Golden Profit Moderado	M.M.	390,94	0,37	1,18	37,17	9,52	40,87	10,19		
<b>TOTAL</b>		<b>204.854.024,06</b>								

<b>ITAU UNIBANCO S/A</b>										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	59.557.615,38	0,27	14,59	27,40	117,55	30,13	125,84		
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	31.796.127,17	0,93	(9,35)	93,49	(75,36)			1,14	8,75
Unibanco Equity Hedge FI Multimercado	M.M.	5.999,09	1,48	12,77	148,49	102,86	163,28	110,11		
<b>TOTAL</b>		<b>91.359.741,64</b>								

<b>BANCO HSBC BANK BRASIL S/A</b>										
Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo	R.F.	83.382.041,89	0,01	14,54	1,18	117,16	1,29	125,43		
Hsbc FI em Ações Ibovespa Top	R.V.	21.438.424,42	(0,42)	(19,46)	(41,73)	(156,76)			(0,20)	(1,35)
Hsbc FI Ações Setorial Ativo	R.V.	3.459.700,39	(3,48)	(25,26)	(348,86)	(203,54)			(3,26)	(7,15)
<b>TOTAL</b>		<b>108.280.166,70</b>								

<b>BANCO SANTANDER S/A</b>										
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	42.609.108,60	0,35	14,65	34,95	118,02	38,43	126,34		
<b>TOTAL</b>		<b>42.609.108,60</b>								

<b>BANCO PANAMERICANO S/A</b>										
Caixa FIDC Master CDC Veículos do Banco Panamericano	R.F.	11.114.957,98	1,02	13,07	101,91	105,32	112,06	112,75		
<b>TOTAL</b>		<b>11.114.957,98</b>								

<b>SCHRODERS INVESTMENT</b>										
Schroder FI em Ações IBrX-50	R.V.	28.508.495,43	(0,73)	(19,80)	(73,27)	(159,49)			(0,52)	(1,69)
<b>TOTAL</b>		<b>28.508.495,43</b>								

<b>GW CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.</b>										
GW Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.687.665,84	(0,54)	(23,86)	(54,35)	(192,22)			(0,33)	(5,75)
<b>TOTAL</b>		<b>1.687.665,84</b>								

<b>BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.</b>										
BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.182.639,25	0,03	(16,58)	3,40	(133,58)			0,25	1,53
<b>TOTAL</b>		<b>2.182.639,25</b>								

<b>BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A</b>										
FIDC Aberto BCSul Verax CPP360	R.F.	52.249.202,57	1,02	13,07	101,91	105,32	112,05	112,75		
FIDC Fechado BCSul Verax Multicred Financeiro	R.F.	27.976.805,17	1,30	16,14	130,27	129,99	143,25	139,16		
<b>TOTAL</b>		<b>80.226.007,74</b>								

<b>BANCO BTG PACTUAL</b>										
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	2.937.850,24	0,00	12,41	0,00	100,00	0,00	107,05		
BTG Pactual Dividendos FI de Ações	R.V.	18.085.220,90	4,20	11,34	421,84	91,33			4,42	29,45
<b>TOTAL</b>		<b>21.023.071,14</b>								

<b>TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO</b>		<b>1.164.168.139,68</b>								<b>DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/12/2011</b>
---	--	-------------------------	--	--	--	--	--	--	--	---

**PLANO PREVIDENCIÁRIO**

<b>CAIXA ECONOMICA FEDERAL</b>										
Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	153.386.828,32	0,70	12,53	69,90	100,98	76,86	108,11		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	40.859.072,54	0,41	15,95	40,90	128,48	44,98	137,54		
FI Caixa Brasil IPCA XV Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	4.678.912,27	2,25	8,77	225,45	70,64	247,91	75,62		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	7.806,20	0,93	11,77	93,12	94,84	102,40	101,53		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	4.542.094,13	1,89	2,90	190,11	23,33	209,04	24,98		
<b>TOTAL</b>		<b>203.474.713,46</b>								



BANCO DO BRASIL S/A											
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	17.978.090,93	0,36	14,56	36,25	117,26	39,87	125,54			
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	864.557,89	0,84	7,27	84,04	58,58	92,42	62,71			
<b>TOTAL</b>		<b>18.842.648,82</b>									
GWI CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.											
GWI Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.177.020,57	(0,54)	(23,86)	(54,35)	(192,22)			(0,33)	(5,75)	
<b>TOTAL</b>		<b>1.177.020,57</b>									
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A											
FIDC Aberto CPP540 RPPS	R.F.	3.812.029,94	1,24	14,50	124,25	116,79	136,63	125,03			
<b>TOTAL</b>		<b>3.812.029,94</b>									
BANCO BTG PACTUAL											
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	1.763.296,81	0,10	16,48	9,60	132,76	10,55	142,12			
<b>TOTAL</b>		<b>1.763.296,81</b>									
<b>TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO</b>		<b>229.069.709,60</b>	<b>DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/12/2011</b>								
<b>TOTAL GERAL APLICADO - (R\$)</b>		<b>1.393.237.849,28</b>	<b>PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO</b>								

**RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 30/12/2011**

PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	373.602.541,01	32,08%	1.055.838,58
FUNDOS DE RENDA FIXA	601.167.192,06	51,62%	3.556.838,95
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	165.036.109,02	14,17%	924.650,84
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	24.362.297,59	2,09%	393.670,89
SALDO EM CONTAS CORRENTES	494.788,22	0,04%	
<b>TOTAIS</b>	<b>1.164.662.927,90</b>	<b>100,00%</b>	<b>5.930.999,26</b>

PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	153.386.828,32	66,93%	1.061.217,64
FUNDOS DE RENDA FIXA	69.963.766,58	30,53%	383.518,75
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	1.177.020,57	0,51%	(6.410,98)
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	4.542.094,13	1,98%	84.466,89
SALDO EM CONTAS CORRENTES	98.873,80	0,04%	
<b>TOTAIS</b>	<b>229.168.583,40</b>	<b>100,00%</b>	<b>1.522.792,30</b>

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

DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	526.989.369,33	37,81%	2.117.056,22
FUNDOS DE RENDA FIXA	671.130.958,64	48,15%	3.940.357,70
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	166.213.129,59	11,92%	918.239,86
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	28.904.391,72	2,07%	478.137,78
SALDO EM CONTAS CORRENTES	593.662,02	0,04%	
<b>TOTAIS</b>	<b>1.393.831.511,30</b>	<b>100,00%</b>	<b>7.453.791,56</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 - DEZEMBRO DE 2011**

INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL S/A	467.744.707,63	580.050,69	468.324.758,32	33,60%	6
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	326.894.915,95	4.277,80	326.899.193,75	23,45%	11
BANCO BRADESCO S/A	204.854.024,06	4.586,43	204.858.610,49	14,70%	5
ITAU UNIBANCO S/A	91.359.741,64	739,94	91.360.481,58	6,55%	3
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	108.280.166,70	4.007,16	108.284.173,86	7,77%	3
BANCO SANTANDER S/A	42.609.108,60	0,00	42.609.108,60	3,06%	1
BANCO PANAMERICANO S/A	11.114.957,98	0,00	11.114.957,98	0,80%	1
SCHRODERS INVESTIMENT	28.508.495,43	0,00	28.508.495,43	2,05%	1
GWI CONSULT. PARTICIP. E SERV. LTDA.	2.864.686,41	0,00	2.864.686,41	0,21%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.182.639,25	0,00	2.182.639,25	0,16%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A	84.038.037,68	0,00	84.038.037,68	6,03%	3
BANCO BTG PACTUAL	22.786.367,95	0,00	22.786.367,95	1,63%	3
<b>TOTAIS</b>	<b>1.393.237.849,28</b>	<b>593.662,02</b>	<b>1.393.831.511,30</b>	<b>100,00%</b>	<b>39</b>

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

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	INDICE	DEZ/11	2011	INDICE	DEZ/11	2011
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IGBE) + 6% a.a.	1,00	12,41	C.D.I.	0,91	11,59
RENDA FIXA	INPC(IGBE) + 6% a.a.	1,00	12,41	C.D.I.	0,91	11,59
RENDA VARIÁVEL	INPC(IGBE) + 6% a.a.	1,00	12,41	IBOVESPA	-0,21	-18,11
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IGBE) + 6% a.a.	1,00	12,41	C.D.I.	0,91	11,59

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 2011, distribuídos em 02 (duas) Carteira de Administradas de Títulos Públicos Federais e 38 (trinta e oito) Fundos de Investimentos, sendo estes últimos distribuídos em 21 (vinte e um) fundos de renda fixa, 11 (onze) fundos de renda variável e 06 (seis) fundos multimercado.