



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

RELATORIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - FEVEREIRO 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

PLANO FINANCEIRO

BANCO DO BRASIL S/A										
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)		52.212.482,02								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	267.356.564,22	0,75	0,88	72,99	35,64	88,97	51,44		
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)		0,00								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-F (PRE)		2.937.502,47								
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	35.286.935,26	0,64	0,32	62,30	12,88	75,95	18,59		
FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F - CAESB	R.F.	20.777.370,94	1,12	2,28	108,90	92,43	132,75	133,42		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	33.777.067,22	0,40	(4,04)	38,90	(163,88)			(0,81)	(1,27)
Brasil Ações IBRX Indexado FIC FI	R.V.	9.190.543,89	1,38	(2,51)	133,94	(101,81)			0,16	0,26
TOTAL		421.538.466,02								

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Caixa FI em Ações Ibovespa Ativo	R.V.	4.024.363,00	1,33	(4,27)	129,78	(172,98)			0,12	(1,49)
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	17.070.946,54	2,03	(2,37)	197,95	(96,29)			0,82	0,40
TOTAL		21.095.309,54								

BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	87.043.432,95	0,63	0,30	60,89	12,23	74,22	17,66		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	44.982.060,14	0,97	1,25	94,28	50,73	114,92	73,22		
Bradesco FIC FI em Ações Ibovespa Indexado	R.V.	16.947.559,29	0,89	(3,43)	86,86	(139,21)			(0,32)	(0,66)
Bradesco FIC FI Multimercado Golden Profit Moderado	M.M.	2.330.056,94	0,69	0,23	66,72	9,24	81,34	13,34		
TOTAL		151.303.109,32								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	46.860.654,72	0,61	0,26	59,14	10,57	72,10	15,26		
Unibanco Private Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	2.877.088,19	0,97	(3,26)	94,06	(132,27)			(0,25)	(0,49)
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	24.055.489,38	0,57	(2,79)	55,85	(113,32)			(0,64)	(0,02)
Unibanco Equity Hedge FI Multimercado	M.M.	5.445,81	1,10	2,37	107,10	95,98	130,55	138,55		
TOTAL		73.798.678,10								

BANCO HSBC BANK BRASIL S/A										
Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo	R.F.	47.269.606,69	1,00	1,41	96,94	57,26	118,17	82,65		
Hsbc FI Ações Top	R.V.	27.934.767,54	1,04	(3,12)	101,70	(126,62)			(0,17)	(0,35)
Hsbc FI Ações Setorial Ativo	R.V.	3.722.953,89	0,06	(3,58)	6,17	(145,06)			(1,15)	(0,80)
TOTAL		78.927.328,12								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI Renda Fixa IMA-B Títulos Públicos	R.F.	28.144.840,74	0,63	0,19	60,92	7,64	74,26	11,03		
TOTAL		28.144.840,74								

BANCO PANAMERICANO S/A										
Master Panamericano FIDC CDC Veículos	R.F.	13.360.750,49	0,94	1,92	91,93	77,67	112,07	112,12		
TOTAL		13.360.750,49								

SCHRODERS INVESTIMENT										
Schroder Previdenciário FI em Ações IBRX-50	R.V.	42.658.364,72	1,60	(2,44)	155,62	(98,86)			0,38	0,33
TOTAL		42.658.364,72								

GWI CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.										
GWI Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.631.887,98	0,39	(2,91)	37,80	(117,93)			(0,83)	(0,14)
TOTAL		1.631.887,98								

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.										
BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.557.039,97	1,59	(2,27)	154,38	(92,08)			0,37	0,50
TOTAL		2.557.039,97								

BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A										
FIDC Aberto BCSul Verax CPP360	R.F.	47.093.542,72	0,94	1,92	91,93	77,67	112,07	112,12		
FIDC Fechado BCSul Verax Multicred Financeiro	R.F.	30.903.240,64	1,46	2,75	142,57	111,49	173,79	160,93		
TOTAL		77.996.783,36								

TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO 913.012.558,36 DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 28/02/2011

PLANO PREVIDENCIÁRIO

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	140.875.105,40	0,49	1,88	48,16	76,29	58,71	110,13		
Caixa FI Novo Brasil RF Crédito Privado LP	R.F.	16.614.097,85	0,69	0,70	67,45	28,31	82,22	40,86		
TOTAL		157.489.203,25								

BANCO DO BRASIL S/A										
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	14.785.425,51	0,64	0,32	62,30	12,88	75,95	18,59		
TOTAL		14.785.425,51								

TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO 172.274.628,76 DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 28/02/2011

TOTAL GERAL APLICADO - (R\$) 1.085.287.187,12 PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 28/02/2011

PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	322.506.548,71	34,94%	2.424.184,98
FUNDOS DE RENDA FIXA	401.722.435,29	43,52%	3.303.646,10
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	186.448.071,61	20,20%	1.974.504,36
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	2.335.502,75	0,25%	15.913,48
SALDO EM CONTAS CORRENTES	10.125.574,79	1,10%	
TOTAIS	923.138.133,15	100,00%	7.718.248,92

PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	140.875.105,40	81,63%	713.645,21
FUNDOS DE RENDA FIXA	31.399.523,36	18,19%	186.276,94
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	0,00	0,00%	0,00
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	0,00	0,00%	0,00
SALDO EM CONTAS CORRENTES	297.893,83	0,03%	
TOTAIS	172.572.522,59	99,86%	899.922,15

CONSOLIDAÇÃO DOS PLANO NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - FEVEREIRO DE 2011			
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	463.381.654,11	42,29%	3.137.830,19
FUNDOS DE RENDA FIXA	433.121.958,65	39,53%	3.489.923,04
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	186.448.071,61	17,02%	1.974.504,36
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	2.335.502,75	0,21%	15.913,48
SALDO EM CONTAS CORRENTES	10.423.468,62	0,95%	
TOTAIS	1.095.710.655,74	100,00%	8.618.171,07

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 - FEVEREIRO DE 2011					
INSTITUIÇÃO	FUNDO	CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL S/A	436.323.891,53	7.902.353,38	444.226.244,91	40,54%	5
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	178.584.512,79	289.377,57	178.873.890,36	16,32%	4
BANCO BRADESCO S/A	151.303.109,32	4.973,72	151.308.083,04	13,81%	4
ITAU UNIBANCO S/A	73.798.678,10	744,94	73.799.423,04	6,74%	4
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	78.927.328,12	2.226.019,01	81.153.347,13	7,41%	3
BANCO SANTANDER S/A	28.144.840,74	0,00	28.144.840,74	2,57%	1
BANCO PANAMERICANO S/A	13.360.750,49	0,00	13.360.750,49	1,22%	1
SCHRODERS INVESTIMENT	42.658.364,72	0,00	42.658.364,72	3,89%	1
GWI CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.	1.631.887,98	0,00	1.631.887,98	0,15%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.557.039,97	0,00	2.557.039,97	0,23%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A	77.996.783,36	0,00	77.996.783,36	7,12%	2
TOTAIS	1.085.287.187,12	10.423.468,62	1.095.710.655,74	100,00%	27

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

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	ÍNDICE	FEV/11	2011	ÍNDICE	FEV/11	2011
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6%	1,03	2,47	C.D.I.	0,84	1,71
RENDA FIXA	INPC(IBGE) + 6%	1,03	2,47	C.D.I.	0,84	1,71
RENDA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6%	1,03	2,47	IBOVESPA	1,21	-2,77
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6%	1,03	2,47	C.D.I.	0,84	1,71

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 fevereiro 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.