

RELATORIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - JANEIRO DE 2011

ALOCÇÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO	S E G M E N T O	VALOR R\$	RENDIMENTO DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
					META ATUARIAL		META GERENCIAL			
					INPC + 6%a.a.		CDI		IBOVESPA	
					1,43	1,43	0,86	0,86	-3,94	-3,94
			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)		53.649.189,76	0,13	0,13	9,00	9,00	14,96	14,96		
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	263.609.162,14								
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)		0,00								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-F (PRE)		2.827.237,21								
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	35.062.634,91	(0,32)	(0,32)	(22,44)	(22,44)	(37,28)	(37,28)		
FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F. - CAESB	R.F.	20.547.628,58	1,15	1,15	80,49	80,49	133,71	133,71		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	33.642.683,75	(4,42)	(4,42)	(309,99)	(309,99)			(0,48)	(0,48)
Brasil Ações IBRX Indexado FIC FI	R.V.	9.065.869,42	(3,83)	(3,83)	(268,66)	(268,66)			0,11	0,11
TOTAL		418.404.405,77								

CAIXA ECONOMICA FEDERAL

Caixa FI em Ações Ibovespa Ativo	R.V.	3.971.441,38	(5,52)	(5,52)	(387,20)	(387,20)			(1,59)	(1,59)
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	16.730.895,02	(4,32)	(4,32)	(302,72)	(302,72)			(0,38)	(0,38)
TOTAL		20.702.336,40								

BANCO BRADESCO S/A

Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	86.502.647,45	(0,32)	(0,32)	(22,54)	(22,54)	(37,44)	(37,44)		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	38.847.649,92	0,28	0,28	19,64	19,64	32,62	32,62		
Bradesco FIC FI em Ações Ibovespa Indexado	R.V.	16.797.757,96	(4,29)	(4,29)	(300,42)	(300,42)			(0,35)	(0,35)
Bradesco FIC FI Multimercado Golden Profit Moderado	M.M.	2.314.202,69	(0,45)	(0,45)	(31,83)	(31,83)	(52,88)	(52,88)		
TOTAL		144.462.258,02								

ITAU UNIBANCO S/A

Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	46.349.768,09	(0,34)	(0,34)	(24,15)	(24,15)	(40,12)	(40,12)		
Unibanco Private Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	2.849.567,49	(4,19)	(4,19)	(293,47)	(293,47)			(0,25)	(0,25)
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	23.300.201,36	(3,35)	(3,35)	(234,70)	(234,70)			0,59	0,59
Unibanco Equity Hedge FI Multimercado	M.M.	5.386,58	1,25	1,25	87,85	87,85	145,95	145,95		
TOTAL		72.504.923,52								

BANCO HSBC BANK BRASIL S/A

Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo	R.F.	42.099.708,08	0,41	0,41	28,91	28,91	48,03	48,03		
Hsbc FI Ações Top	R.V.	27.646.092,45	(4,12)	(4,12)	(289,01)	(289,01)			(0,18)	(0,18)
Hsbc FI Ações Setorial Ativo	R.V.	3.720.598,48	(3,64)	(3,64)	(254,99)	(254,99)			0,30	0,30
TOTAL		73.466.399,01								

BANCO SANTANDER S/A

Santander FIC FI Renda Fixa IMA-B Títulos Públicos	R.F.	27.969.895,24	(0,43)	(0,43)	(30,44)	(30,44)	(50,57)	(50,57)		
TOTAL		27.969.895,24								

BANCO PANAMERICANO S/A

Master Panamericano FIDC CDC Veículos	R.F.	13.235.813,04	0,96	0,96	67,45	67,45	112,05	112,05		
TOTAL		13.235.813,04								

SCHROEDERS INVESTIMENT

Schroder Previdenciário FI em Ações IBRX-50	R.V.	41.987.473,74	(3,97)	(3,97)	(278,41)	(278,41)			(0,03)	(0,03)
TOTAL		41.987.473,74								

GW CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.

GW Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.625.579,32	(3,28)	(3,28)	(230,12)	(230,12)			0,66	0,66
TOTAL		1.625.579,32								

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.

BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.517.141,15	(3,80)	(3,80)	(266,02)	(266,02)			0,14	0,14
TOTAL		2.517.141,15								

BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A

FIDC Aberto BCSul Verax CPP360	R.F.	46.653.168,47	0,96	0,96	67,45	67,45	112,05	112,05		
FIDC Fechado BCSul Verax Multicred Financeiro	R.F.	30.457.405,44	1,27	1,27	88,79	88,79	147,51	147,51		
TOTAL		77.110.573,91								

TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO 893.986.799,12 DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 31/01/2011

PLANO PREVIDENCIÁRIO

CAIXA ECONOMICA FEDERAL

Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	144.330.658,31	1,38	1,38	96,72	96,72	160,69	160,69		
Caixa FI Novo Brasil RF Crédito Privado LP	R.F.	8.996.099,55	0,01	0,01	0,38	0,38	0,64	0,64		
TOTAL		153.326.757,86								

BANCO DO BRASIL S/A

BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	14.309.806,97	(0,32)	(0,32)	(22,44)	(22,44)	(37,28)	(37,28)		
TOTAL		14.309.806,97								

TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO 167.636.564,83 DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 31/01/2011

TOTAL GERAL APLICADO - (R\$) 1.061.623.363,95 PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 31/01/2011

PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	320.085.589,11	35,70%	437.292,96
FUNDOS DE RENDA FIXA	387.726.319,22	43,25%	760.799,74
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	183.855.301,52	20,51%	(7.776.085,70)
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	2.319.589,27	0,26%	(10.491,09)
SALDO EM CONTAS CORRENTES	2.531.453,91	0,28%	
TOTAIS	896.518.253,03	100,00%	(6.588.484,09)

PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	144.330.658,31	86,03%	1.963.022,38
FUNDOS DE RENDA FIXA	23.305.906,52	13,89%	(44.485,18)
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	0,00	0,00%	0,00
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	0,00	0,00%	0,00
SALDO EM CONTAS CORRENTES	127.976,91	0,01%	
TOTAIS	167.764.541,74	99,94%	1.918.537,20

CONSOLIDAÇÃO DOS PLANOS NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - JANEIRO DE 2011 PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	464.416.247,42	43,64%	2.400.315,34
FUNDOS DE RENDA FIXA	411.032.225,74	38,62%	716.314,56
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	183.855.301,52	17,28%	(7.776.085,70)
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	2.319.589,27	0,22%	(10.491,09)
SALDO EM CONTAS CORRENTES	2.659.430,82	0,25%	
TOTAIS	1.064.282.794,77	100,00%	(4.669.946,89)

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 2011					
INSTITUIÇÃO	FUNDO	CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL S/A	432.714.212,74	818.916,99	433.533.129,73	40,73%	5
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	174.029.094,26	12.181,07	174.041.275,33	16,35%	4
BANCO BRADESCO S/A	144.462.258,02	1.204.586,43	145.666.844,45	13,69%	4
ITAU UNIBANCO S/A	72.504.923,52	619.727,40	73.124.650,92	6,87%	4
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	73.466.399,01	4.018,93	73.470.417,94	6,90%	3
BANCO SANTANDER S/A	27.969.895,24	0,00	27.969.895,24	2,63%	1
BANCO PANAMERICANO S/A	13.235.813,04	0,00	13.235.813,04	1,24%	1
SCHROEDERS INVESTIMENT	41.987.473,74	0,00	41.987.473,74	3,95%	1
GWI CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.	1.625.579,32	0,00	1.625.579,32	0,15%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.517.141,15	0,00	2.517.141,15	0,24%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A	77.110.573,91	0,00	77.110.573,91	7,25%	2
TOTAIS	1.061.623.363,95	2.659.430,82	1.064.282.794,77	100,00%	27

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

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	ÍNDICE	JAN/11	2011	ÍNDICE	JAN/11	2011
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IGBE) + 6%	1,43	1,43	C.D.I.	0,86	0,86
RENDA FIXA	INPC(IGBE) + 6%	1,43	1,43	C.D.I.	0,86	0,86
RENDA VARIÁVEL	INPC(IGBE) + 6%	1,43	1,43	IBOVESPA	-3,94	-3,94
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IGBE) + 6%	1,43	1,43	C.D.I.	0,86	0,86

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 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.