

RELATORIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - JUNHO 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)		33.538.912,43								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	295.107.517,76	0,24	4,91	33,35	73,82	24,77	89,08		
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)		0,00								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-F (PRE)		6.868.860,02								
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	35.823.523,13	(0,28)	3,55	(40,11)	53,29	(29,79)	64,31		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	1.240.741,57	0,88	0,00	125,15	0,00	92,94	0,00		
FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F - CAESB	R.F.	19.907.427,90	1,17	7,15	165,55	107,37	122,94	129,57		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	23.389.285,96	(3,76)	(12,54)	(531,80)	(188,38)			(0,33)	(2,58)
Brasil Ações IBRX Indexado FIC FI	R.V.	8.512.791,51	(2,04)	(9,70)	(289,20)	(145,72)			1,39	0,26
TOTAL		424.389.060,28								

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
FI Caixa Brasil IPCA XI Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	12.573.475,00	0,59	0,00	83,17	0,00	61,76	0,00		
FI Caixa Brasil IPCA XII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	12.573.775,00	0,59	0,00	83,51	0,00	62,02	0,00		
Caixa FI em Ações Ibovespa Ativo	R.V.	0,00	(3,79)	(13,00)	(535,56)	(195,33)			(0,36)	(3,04)
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	16.323.809,58	(1,94)	(10,39)	(273,94)	(156,08)			1,49	(0,43)
TOTAL		41.471.059,58								

BRADESCO S/A										
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	100.176.486,53	(0,31)	3,61	(43,94)	54,27	(32,63)	65,50		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	64.834.349,73	0,58	5,09	82,33	76,51	61,14	92,33		
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.	15.246.978,04	(3,84)	(1,71)	(543,01)	(25,69)			(0,41)	8,25
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	2.345.287,87	0,93	5,58	131,45	83,87	97,6	101,22		
Bradesco FIC FI Multimercado Golden Profit Moderado	M.M.	387,32	(0,39)	0,24	(55,70)	3,67	(41,37)	4,43		
TOTAL		182.603.489,49								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	51.806.393,72	(0,34)	3,45	(48,79)	51,77	(36,23)	62,47		
Unibanco Private Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	0,00	(2,45)	(10,21)	(346,64)	(153,37)			0,98	(0,25)
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	26.349.240,55	(2,24)	(4,37)	(317,30)	(65,68)			1,19	5,59
Unibanco Equity Hedge FI Multimercado	M.M.	5.663,89	1,37	6,47	194,01	97,14	144,08	117,23		
TOTAL		78.161.298,16								

BANCO HSBC BANK BRASIL S/A										
Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo	R.F.	69.925.501,71	0,73	5,22	102,75	78,40	76,31	94,61		
Hsbc FI em Ações Ibovespa Top	R.V.	23.717.857,93	(3,58)	(10,89)	(506,12)	(163,67)			(0,15)	(0,94)
Hsbc FI Ações Setorial Ativo	R.V.	4.092.313,48	(3,90)	(11,60)	(551,72)	(174,25)			(0,47)	(1,64)
TOTAL		97.735.673,12								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	36.730.335,95	(0,33)	3,51	(46,13)	52,71	(34,26)	63,61		
TOTAL		36.730.335,95								

BANCO PANAMERICANO S/A										
Caixa FIDC Master CDC Veículos do Banco Panamericano	R.F.	13.922.138,53	1,07	6,20	150,88	93,11	112,05	112,36		
TOTAL		13.922.138,53								

SCHROEDERS INVESTMENT										
Schroder FI em Ações IBRX-50	R.V.	32.056.830,83	(2,36)	(9,81)	(333,75)	(147,43)			1,07	0,14
TOTAL		32.056.830,83								

GWÍ CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.										
GWÍ Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	2.212.492,78	0,01	(0,18)	1,68	(2,71)			3,44	9,78
TOTAL		2.212.492,78								

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.										
BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.393.445,88	(3,09)	(8,52)	(437,10)	(128,05)			0,34	1,43
TOTAL		2.393.445,88								

BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A										
FIDC Aberto BCSul Verax CPP360	R.F.	49.072.305,88	1,07	6,20	150,88	93,11	112,05	112,36		
FIDC Fechado BCSul Verax Multicred Financeiro	R.F.	32.317.860,74	0,72	7,45	101,73	111,96	75,55	135,11		
TOTAL		81.390.166,62								

TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO 993.065.991,22 DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/06/2011

PLANO PREVIDENCIÁRIO

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	146.954.268,66	0,95	6,28	134,25	94,29	99,70	113,79		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	24.541.394,04	(0,13)	4,12	(17,71)	61,86	(13,15)	74,65		
TOTAL		171.495.662,70								

BANCO DO BRASIL S/A										
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	16.270.439,75	(0,28)	3,55	(40,11)	53,29	(29,79)	64,31		
TOTAL		16.270.439,75								

GWÍ CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.										
GWÍ Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.543.048,06	0,01	(0,18)	1,68	(2,71)			3,44	9,78
TOTAL		1.543.048,06								

TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO 189.309.150,51 DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/06/2011

TOTAL GERAL APLICADO - (R\$) 1.182.375.141,73 PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 30/06/2011

PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	335.515.290,21	33,20%	816.928,75
FUNDOS DE RENDA FIXA	500.904.315,39	49,56%	1.346.769,61
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	154.295.046,54	15,27%	(5.006.805,14)
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	2.351.339,08	0,23%	6.106,18
SALDO EM CONTAS CORRENTES	17.659.012,97	1,75%	
TOTAIS	1.010.725.004,19	100,00%	(2.837.000,60)

PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	146.954.268,66	76,22%	1.381.178,08
FUNDOS DE RENDA FIXA	40.811.833,79	21,17%	(78.204,29)
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	1.543.048,06	0,80%	183,28
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	0,00	0,00%	0,00
SALDO EM CONTAS CORRENTES	3.491.775,15	1,81%	
TOTAIS	192.800.925,66	100,00%	1.303.157,07

CONSOLIDAÇÃO DOS PLANO NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - JUNHO DE 2011 PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	482.469.558,87	40,09%	2.198.106,83
FUNDOS DE RENDA FIXA	541.716.149,18	45,01%	1.268.565,32
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	155.838.094,60	12,95%	(5.006.621,86)
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	2.351.339,08	0,20%	6.106,18
SALDO EM CONTAS CORRENTES	21.150.788,12	1,76%	
TOTAIS	1.203.525.929,85	100,00%	(1.533.843,53)

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 - JUNHO DE 2011					
INSTITUIÇÃO	FUNDO	CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL S/A	440.659.500,03	20.803.688,89	461.463.188,92	38,34%	6
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	212.966.722,28	1.256,28	212.967.978,56	17,70%	6
BANCO BRADESCO S/A	182.603.489,49	4.586,43	182.608.075,92	15,17%	5
ITAU UNIBANCO S/A	78.161.298,16	742,44	78.162.040,60	6,49%	4
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	97.735.673,12	340.514,08	98.076.187,20	8,15%	3
BANCO SANTANDER S/A	36.730.335,95	0,00	36.730.335,95	3,05%	1
BANCO PANAMERICANO S/A	13.922.138,53	0,00	13.922.138,53	1,16%	1
SCHRODERS INVESTIMENT	32.056.830,83	0,00	32.056.830,83	2,66%	1
GWI CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.	3.755.540,84	0,00	3.755.540,84	0,31%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.393.445,88	0,00	2.393.445,88	0,20%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A	81.390.166,62	0,00	81.390.166,62	6,76%	2
TOTAIS	1.182.375.141,73	21.150.788,12	1.203.525.929,85	100,00%	31

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

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	ÍNDICE	JUN/11	2011	ÍNDICE	JUN/11	2011
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,71	6,66	C.D.I.	0,95	5,52
RENDA FIXA	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,71	6,66	C.D.I.	0,95	5,52
RENDA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,71	6,66	IBOVESPA	-3,43	-9,96
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,71	6,66	C.D.I.	0,95	5,52

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 junho de 2011, distribuídos em 02 (duas) Carteira de Administradas de Títulos Públicos Federais e 28 (vinte e oito) Fundos de Investimentos, sendo estes últimos distribuídos em 14 (quatorze) fundos de renda fixa, 12 (doze) fundos de renda variável e 03 (três) fundos multimercado.