

RELATORIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - MAIO DE 2011

ALOCACÃO 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	
					1,06	5,94	0,99	4,52	-2,29	-6,76
			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)		33.221.482,06								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	294.660.833,12	1,48	4,67	139,84	78,60	149,94	103,22		
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)		0,00								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-F (PRE)		6.816.046,28								
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	37.995.517,87	1,44	3,84	136,17	64,70	146,01	84,98		
FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F. - CAESB	R.F.	20.081.692,78	1,20	5,92	113,56	99,70	121,76	130,94		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	31.987.959,01	(2,53)	(9,12)	(239,71)	(153,66)			(0,25)	(2,36)
Brasil Ações IBRX Indexado FIC FI	R.V.	8.690.416,74	(2,57)	(7,82)	(242,92)	(131,63)			(0,28)	(1,06)
TOTAL		433.453.947,86								

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Caixa FI em Ações Ibovespa Ativo	R.V.	3.800.997,48	(3,40)	(9,58)	(321,73)	(161,33)			(1,11)	(2,82)
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	18.185.142,01	(3,78)	(8,62)	(357,82)	(145,18)			(1,49)	(1,86)
TOTAL		21.986.139,49								

BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	96.143.403,27	1,52	3,94	143,85	66,28	154,25	87,05		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	58.665.473,34	1,21	4,48	114,40	75,53	122,67	99,19		
Bradesco FIC FI em Ações Ibovespa Indexado	R.V.	0,00	(2,64)	(8,36)	(249,44)	(140,86)			(0,35)	(1,60)
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.	15.855.470,82	1,31	2,21	124,26	37,26				
Bradesco FIC FI Multimercado Golden Profit Moderado	M.M.	2.339.645,62	(0,02)	0,64	(2,32)	10,78	(2,49)	14,16		
TOTAL		173.003.993,05								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	51.985.662,88	1,46	3,80	138,01	64,06	147,98	84,13		
Unibanco Private Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	2.737.552,95	(2,55)	(7,95)	(241,38)	(133,95)			(0,26)	(1,19)
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	26.953.682,74	(0,71)	(2,18)	(67,14)	(36,68)			1,58	4,58
Unibanco Equity Hedge FI Multimercado	M.M.	5.587,28	0,74	5,03	70,24	84,65	75,32	111,17		
TOTAL		81.682.485,85								

BANCO HSBC BANK BRASIL S/A										
Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo	R.F.	64.210.186,44	1,07	4,46	101,32	75,11	108,64	98,64		
Hsbc FI em Ações Ibovespa Top	R.V.	26.646.759,69	(2,43)	(7,59)	(230,36)	(127,81)			(0,15)	(0,83)
Hsbc FI Ações Setorial Ativo	R.V.	4.258.359,89	(2,44)	(8,01)	(230,83)	(134,93)			(0,15)	(1,25)
TOTAL		95.115.306,02								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	32.505.631,58	1,56	3,85	147,64	64,79	158,31	85,09		
TOTAL		32.505.631,58								

BANCO PANAMERICANO S/A										
Caixa FIDC Master CDC Veículos do Banco Panamericano	R.F.	13.775.244,59	1,10	5,08	104,50	85,51	112,06	112,30		
TOTAL		13.775.244,59								

SCHROEDERS INVESTMENT										
Schroder Previdenciário FI em Ações IBRX-50	R.V.	40.386.005,50	(3,04)	(7,63)	(287,95)	(128,58)			(0,76)	(0,88)
TOTAL		40.386.005,50								

GWJ CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.										
GWJ Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	2.212.229,97	(1,52)	(0,19)	(143,60)	(3,24)			0,77	6,57
TOTAL		2.212.229,97								

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.										
BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.469.741,34	(1,74)	(5,61)	(164,26)	(94,43)			0,55	1,15
TOTAL		2.469.741,34								

BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A										
FIDC Aberto BCSul Verax CPP360	R.F.	48.554.538,61	1,10	5,08	104,50	85,51	112,06	112,30		
FIDC Fechado BCSul Verax Multicred Financeiro	R.F.	32.087.151,23	1,18	6,69	111,68	112,60	119,75	147,88		
TOTAL		80.641.689,84								

TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO		977.232.415,09	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 31/05/2011							
---	--	-----------------------	---	--	--	--	--	--	--	--

PLANO PREVIDENCIÁRIO

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	145.573.090,58	0,45	5,27	42,55	88,83	45,62	116,66		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	23.186.067,41	1,54	4,25	145,60	71,54	156,12	93,96		
TOTAL		168.759.157,99								

BANCO DO BRASIL S/A										
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	15.413.887,01	1,44	3,84	136,17	64,70	146,01	84,98		
TOTAL		15.413.887,01								

GWJ CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.										
GWJ Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.542.864,78	(1,52)	(0,19)	(143,60)	(3,24)	(153,98)	(4,25)		
TOTAL		1.542.864,78								

TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO		185.715.909,78	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 31/05/2011							
---	--	-----------------------	---	--	--	--	--	--	--	--

TOTAL GERAL APLICADO - (R\$)		1.162.948.324,87	PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO							
-------------------------------------	--	-------------------------	--	--	--	--	--	--	--	--

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 31/05/2011

PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	334.698.361,46	33,64%	4.902.699,99
FUNDOS DE RENDA FIXA	456.004.502,59	45,83%	5.907.660,44
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	184.184.318,14	18,51%	(4.951.682,22)
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	2.345.232,90	0,24%	(532,72)
SALDO EM CONTAS CORRENTES	17.680.964,87	1,78%	
TOTAIS	994.913.379,96	100,00%	5.858.145,49

PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	145.573.090,58	77,60%	651.498,73
FUNDOS DE RENDA FIXA	38.599.954,42	20,58%	575.439,59
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	1.542.864,78	0,82%	16.243,86
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	0,00	0,00%	0,00
SALDO EM CONTAS CORRENTES	1.871.993,83	1,00%	
TOTAIS	187.587.903,61	100,00%	1.243.182,18

CONSOLIDAÇÃO DOS PLANOS NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - MAIO DE 2011 PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	480.271.452,04	40,61%	5.554.198,72
FUNDOS DE RENDA FIXA	494.604.457,01	41,83%	6.483.100,03
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	185.727.182,92	15,71%	(4.935.438,36)
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	2.345.232,90	0,20%	(532,72)
SALDO EM CONTAS CORRENTES	19.552.958,70	1,65%	
TOTAIS	1.182.501.283,57	100,00%	7.101.327,67

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 - MAIO DE 2011					
INSTITUIÇÃO	FUNDO	CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL S/A	448.867.834,87	19.542.354,59	468.410.189,46	39,61%	5
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	190.745.297,48	1.256,28	190.746.553,76	16,13%	4
BANCO BRADESCO S/A	173.003.993,05	4.586,43	173.008.579,48	14,63%	5
ITAU UNIBANCO S/A	81.682.485,85	742,44	81.683.228,29	6,91%	4
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	95.115.306,02	4.018,96	95.119.324,98	8,04%	3
BANCO SANTANDER S/A	32.505.631,58	0,00	32.505.631,58	2,75%	1
BANCO PANAMERICANO S/A	13.775.244,59	0,00	13.775.244,59	1,16%	1
SCHROEDERS INVESTMENT	40.386.005,50	0,00	40.386.005,50	3,42%	1
GWI CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.	3.755.094,75	0,00	3.755.094,75	0,32%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.469.741,34	0,00	2.469.741,34	0,21%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A	80.641.689,84	0,00	80.641.689,84	6,82%	2
TOTAIS	1.162.948.324,87	19.552.958,70	1.182.501.283,57	100,00%	28

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

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	ÍNDICE	MAI/11	2011	ÍNDICE	MAI/11	2011
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,06	5,94	C.D.I.	0,99	4,52
RENDA FIXA	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,06	5,94	C.D.I.	0,99	4,52
RENDA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,06	5,94	IBOVESPA	-2,29	-6,76
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,06	5,94	C.D.I.	0,99	4,52

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 maio de 2011, distribuídos em 02 (duas) Carteira de Administradas de Títulos Públicos Federais e 26 (vinte e seis) Fundos de Investimentos, sendo estes últimos distribuídos em 11 (onze) fundos de renda fixa, 13 (treze) fundos de renda variável e 02 (dois) fundos multimercado.