

RELATORIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - NOVEMBRO DE 2011

ALOCACÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO	SEGMENTO	VALOR R\$	RENDIMENTO DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
					META ATUARIAL		META GERENCIAL			
					INPC + 6%a.a.		CDI		IBOVESPA	
					1,06	11,03	0,86	10,59	-2,51	-17,94
			NO	NO ANO	NO	NO ANO	NO	NO ANO	NO	NO ANO
			MÊS	2011	MÊS	2011	MÊS	2011	MÊS	2011

PLANO FINANCEIRO

BANCO DO BRASIL S/A										
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)		43.599.415,20								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	328.947.287,23	1,89	16,44	178,78	149,11	219,98	155,26		
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)		0,00								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-F (PRE)		0,00								
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	29.248.426,53	2,03	14,14	191,85	128,24	236,06	133,52		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	899.214,29	0,80	6,38	75,70	57,85	93,14	60,24		
FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F. - CAESB	R.F.	18.914.627,47	1,07	13,54	101,27	122,78	124,61	127,84		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	21.009.030,72	(2,94)	(21,44)	(278,48)	(194,41)			(0,43)	(3,51)
Brasil Ações IBrX Indexado FIC FI	R.V.	7.753.739,96	(1,84)	(17,75)	(174,58)	(160,96)			0,66	0,18
TOTAL		450.371.741,40								

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
FI Caixa Brasil IPCA XI Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	13.999.425,00	0,95	12,00	90,07	108,77	110,82	113,25		
FI Caixa Brasil IPCA XII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	14.000.612,50	0,95	12,00	89,98	108,85	110,71	113,34		
FI Caixa Brasil IPCA XIII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	13.664.650,00	0,91	9,32	86,21	84,48	106,07	87,96		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	55.602,56	0,87	10,74	82,46	97,42	101,47	101,43		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	35.138.516,72	2,02	15,48	191,60	140,33	235,75	146,11		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	2.928.130,08	1,40	14,96	132,41	135,68	162,92	141,27		
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	14.917.879,01	(1,20)	(18,11)	(114,04)	(164,19)			1,30	(0,17)
FI Caixa Brasil IPCA V Multimercado Crédito Privado	M.M.	12.623.012,50	0,94	0,00	89,13	0,00	109,67	0,00		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	4.645.190,40	0,94	0,00	88,97	0,00	109,47	0,00		
FI Caixa Brasil IPCA VIII Multimercado Crédito Privado	M.M.	4.229.535,29	0,13	0,00	12,52	0,00	15,41	0,00		
TOTAL		116.202.554,06								

BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	115.183.122,50	2,02	14,41	190,98	130,63	234,99	136,01		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	71.725.460,42	1,57	13,38	148,86	121,33	183,16	126,33		
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.	13.856.423,32	(3,07)	(10,67)	(290,18)	(96,79)			(0,56)	7,26
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	2.464.587,42	0,91	10,95	86,42	99,32	106,3	103,41		
Bradesco FIC FI Multimercado Golden Profit Moderado	M.M.	389,50	(0,10)	0,81	(9,42)	7,33	(11,59)	7,63		
TOTAL		203.229.983,16								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	57.886.389,89	1,99	14,28	188,43	129,47	231,84	134,81		
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	31.502.561,96	(1,05)	(10,19)	(99,37)	(92,41)			1,46	7,74
Unibanco Equity Hedge FI Multimercado	M.M.	5.911,59	1,25	11,12	118,51	100,85	145,82	105,01		
TOTAL		89.394.863,44								

BANCO HSBC BANK BRASIL S/A										
Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo	R.F.	83.372.249,20	2,45	14,53	231,50	131,74	284,84	137,17		
Hsbc FI em Ações Ibovespa Top	R.V.	21.527.965,48	(2,65)	(19,12)	(250,53)	(173,39)			(0,14)	(1,19)
Hsbc FI Ações Setorial Ativo	R.V.	3.584.334,95	(5,38)	(22,57)	(509,54)	(204,67)			(2,88)	(4,64)
TOTAL		108.484.549,63								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	42.461.189,44	2,07	14,25	196,32	129,22	241,55	134,54		
TOTAL		42.461.189,44								

BANCO PANAMERICANO S/A										
Caixa FIDC Master CDC Veículos do Banco Panamericano	R.F.	14.674.393,64	0,96	11,94	91,07	108,23	112,06	112,69		
TOTAL		14.674.393,64								

SCHROEDERS INVESTIMENT										
Schroder FI em Ações IBrX-50	R.V.	28.718.238,99	(2,68)	(19,21)	(254,04)	(174,15)			(0,18)	(1,27)
TOTAL		28.718.238,99								

GWJ CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.										
GWJ Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.696.858,19	(3,01)	(23,44)	(284,95)	(212,58)			(0,50)	(5,51)
TOTAL		1.696.858,19								

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.										
BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.181.900,71	(2,19)	(16,61)	(207,67)	(150,59)			0,31	1,33
TOTAL		2.181.900,71								

BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A										
FIDC Aberto BCSul Verax CPP360	R.F.	51.723.828,59	0,96	11,94	91,07	108,23	112,06	112,69		
FIDC Fechado BCSul Verax Multicred Financeiro	R.F.	27.618.193,18	2,49	14,65	235,67	132,81	289,97	138,28		
TOTAL		79.342.021,77								

BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	2.916.043,14	0,00	11,03	0,00	100,00	0,00	104,12		
BTG Pactual Dividendos FI de Ações	R.V.	17.093.601,07	1,47	6,84	138,77	62,06			3,97	24,78
TOTAL		20.009.644,21								

TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO		1.156.767.938,64	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/11/2011							
---	--	-------------------------	---	--	--	--	--	--	--	--

PLANO PREVIDENCIÁRIO

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	152.325.610,68	0,66	11,76	62,04	106,59	76,34	110,99		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	40.418.352,21	2,02	15,48	191,60	140,33	235,75	146,11		
FI Caixa Brasil IPCA XV Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	4.576.079,27	0,94	6,38	89,19	57,83	109,74	60,21		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	7.734,40	0,87	10,74	82,46	97,42	101,47	101,43		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	4.457.627,24	0,94	0,00	88,97	0,00	109,47	0,00		
TOTAL		201.785.403,80								

BANCO DO BRASIL S/A									
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	17.870.872,73	2,03	14,14	191,85	128,24	236,06	133,52	
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	0,00	0,80	6,38	75,70	57,85	93,14	60,24	
TOTAL		17.870.872,73							
GWI CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.									
GWI Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.183.431,55	(3,01)	(23,44)	(284,95)	(212,58)		(0,50)	(5,51)
TOTAL		1.183.431,55							
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A									
FIDC Aberto CPP540 RPPS	R.F.	3.765.397,04	1,09	13,10	103,46	118,74	127,30	123,64	
TOTAL		3.765.397,04							
BANCO BTG PACTUAL									
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	1.761.611,64	1,43	16,37	135,60	148,40	166,85	154,52	
TOTAL		1.761.611,64							
TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO		226.366.716,76	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/11/2011						
TOTAL GERAL APLICADO - (R\$)		1.383.134.655,40	PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO						

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 30/11/2011

PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	372.546.702,43	32,12%	6.935.639,68
FUNDOS DE RENDA FIXA	596.410.075,15	51,42%	10.646.586,79
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	163.842.534,36	14,13%	(3.204.818,19)
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	23.968.626,70	2,07%	188.982,46
SALDO EM CONTAS CORRENTES	3.034.838,05	0,26%	
TOTAIS	1.159.802.776,69	100,00%	14.566.390,74
PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	152.325.610,68	67,14%	991.925,51
FUNDOS DE RENDA FIXA	68.400.047,29	30,15%	1.222.520,37
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	1.183.431,55	0,52%	(36.735,03)
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	4.457.627,24	1,96%	41.511,72
SALDO EM CONTAS CORRENTES	523.724,41	0,23%	
TOTAIS	226.890.441,17	100,00%	2.219.222,57

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

DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	524.872.313,11	37,85%	7.927.565,19
FUNDOS DE RENDA FIXA	664.810.122,44	47,94%	11.869.107,16
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	165.025.965,91	11,90%	(3.241.553,22)
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	28.426.253,94	2,05%	230.494,18
SALDO EM CONTAS CORRENTES	3.558.562,46	0,26%	
TOTAIS	1.386.693.217,86	100,00%	16.785.613,31

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 - NOVEMBRO DE 2011

INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL S/A	468.242.614,13	2.418.982,16	470.661.596,29	33,94%	6
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	317.987.957,86	4.277,80	317.992.235,66	22,93%	11
BANCO BRADESCO S/A	203.229.983,16	567.570,92	203.797.554,08	14,70%	5
ITAU UNIBANCO S/A	89.394.863,44	563.724,42	89.958.587,86	6,49%	3
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	108.484.549,63	4.007,16	108.488.556,79	7,82%	3
BANCO SANTANDER S/A	42.461.189,44	0,00	42.461.189,44	3,06%	1
BANCO PANAMERICANO S/A	14.674.393,64	0,00	14.674.393,64	1,06%	1
SCHROEDERS INVESTIMENT	28.718.238,99	0,00	28.718.238,99	2,07%	1
GWI CONSULT. PARTICIP. E SERV. LTDA.	2.880.289,74	0,00	2.880.289,74	0,21%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.181.900,71	0,00	2.181.900,71	0,16%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A	83.107.418,81	0,00	83.107.418,81	5,99%	3
BANCO BTG PACTUAL	21.771.255,85	0,00	21.771.255,85	1,57%	3
TOTAIS	1.383.134.655,40	3.558.562,46	1.386.693.217,86	100,00%	39

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

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	ÍNDICE	OUT/11	2011	ÍNDICE	OUT/11	2011
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(ÍBGE) + 6% a.a.	1,06	11,03	C.D.I.	0,86	10,59
RENDA FIXA	INPC(ÍBGE) + 6% a.a.	1,06	11,03	C.D.I.	0,86	10,59
RENDA VARIÁVEL	INPC(ÍBGE) + 6% a.a.	1,06	11,03	IBOVESPA	-2,51	-17,94
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(ÍBGE) + 6% a.a.	1,06	11,03	C.D.I.	0,86	10,59

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 novembro de 2011, distribuídos em 02 (duas) Carteira de Administradas de Títulos Públicos Federais e 37 (trinta e sete) Fundos de Investimentos, sendo estes últimos distribuídos em 20 (dezoito) fundos de renda fixa, 11 (onze) fundos de renda variável e 06 (três) fundos multimercado.