

RELATORIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - OUTUBRO 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	
					0,81	9,92	0,88	9,65	11,49	-15,82
			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)		40.020.364,19								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	325.593.340,77	1,15	14,29	142,84	144,02	130,57	148,04		
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.	32.872.532,98	1,62	11,88	200,73	119,71	183,49	123,05		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	752.101,19	0,82	5,54	102,06	55,81	93,30	57,37		
FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F. - CAESB	R.F.	19.147.750,03	1,09	12,34	135,11	124,39	123,50	127,86		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	21.645.913,08	11,35	(19,06)	1.406,24	(192,13)			(0,15)	(3,24)
Brasil Ações IBRX Indexado FIC FI	R.V.	7.899.450,46	8,49	(16,21)	1.052,95	(163,37)			(3,00)	(0,38)
TOTAL		447.931.452,70								

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
FI Caixa Brasil IPCA XI Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	13.867.462,50	0,96	10,94	119,28	110,28	109,03	113,36		
FI Caixa Brasil IPCA XII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	13.868.762,50	0,96	10,95	119,17	110,39	108,94	113,47		
FI Caixa Brasil IPCA XIII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	13.541.312,50	1,00	8,33	123,42	83,98	112,82	86,32		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	38.369,39	0,89	9,79	110,60	98,67	101,10	101,42		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	26.768.366,06	1,70	13,19	210,64	132,92	192,55	136,63		
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	15.099.825,89	9,43	(17,11)	1.169,12	(172,47)			(2,06)	(1,28)
FI Caixa Brasil IPCA V Multimercado Crédito Privado	M.M.	12.505.250,00	0,04	0,00	5,21	0,00	4,76	0,00		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	4.601.932,00	0,04	0,00	5,21	0,00	4,76	0,00		
TOTAL		100.291.280,84								

BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	109.109.931,15	1,62	12,14	200,71	122,42	183,47	125,83		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	70.614.816,01	1,12	11,63	139,26	117,20	127,30	120,46		
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.	14.294.694,00	4,03	(7,85)	499,82	(79,13)			(7,46)	7,97
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	2.442.286,86	0,88	9,95	109,07	100,31	99,7	103,10		
Bradesco FIC FI Multimercado Golden Profit Moderado	M.M.	389,89	2,87	0,91	356,30	9,16	325,70	9,42		
TOTAL		196.462.117,91								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	56.756.459,10	1,52	12,05	188,53	121,46	172,34	124,85		
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	29.841.975,26	8,94	(9,24)	1.108,61	(93,13)			(2,55)	6,58
Unibanco Equity Hedge FI Multimercado	M.M.	5.838,48	0,90	9,75	111,86	98,27	102,26	101,01		
TOTAL		86.604.272,84								

BANCO HSBC BANK BRASIL S/A										
Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo	R.F.	81.381.762,69	1,14	11,79	141,23	118,90	129,10	122,22		
Hsbc FI em Ações Ibovespa Top	R.V.	22.113.306,15	11,19	(16,92)	1.386,67	(170,60)			(0,31)	(1,10)
Hsbc FI Ações Setorial Ativo	R.V.	3.788.279,63	11,20	(18,17)	1.388,34	(183,14)			(0,29)	(2,34)
TOTAL		107.283.348,47								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	41.598.351,11	1,53	11,93	189,53	120,26	173,25	123,61		
TOTAL		41.598.351,11								

BANCO PANAMERICANO S/A										
Caixa FIDC Master CDC Veículos do Banco Panamericano	R.F.	14.534.536,54	0,99	10,87	122,57	109,57	112,05	112,63		
TOTAL		14.534.536,54								

SCHROEDERS INVESTIMENT										
Schroder FI em Ações IBRX-50	R.V.	29.510.337,95	10,32	(16,98)	1.279,11	(171,15)			(1,17)	(1,15)
TOTAL		29.510.337,95								

GW CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.										
GW Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.749.530,56	11,13	(21,07)	1.380,05	(212,38)			(0,36)	(5,24)
TOTAL		1.749.530,56								

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.										
BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.230.850,25	10,86	(14,74)	1.345,66	(148,57)			(0,64)	1,09
TOTAL		2.230.850,25								

BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A										
FIDC Aberto BCSul Verax CPP360	R.F.	51.230.865,11	0,99	10,87	122,57	109,57	112,05	112,63		
FIDC Fechado BCSul Verax Multicred Financeiro	R.F.	33.643.804,67	1,00	11,86	124,17	119,57	113,51	122,91		
TOTAL		84.874.669,78								

BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual Dividendos FI de Ações	R.V.	14.000.225,25	4,17	5,30	517,09	53,43			(7,32)	21,12
TOTAL		14.000.225,25								

TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO		1.127.070.974,20	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 31/10/2011							
---	--	-------------------------	---	--	--	--	--	--	--	--

PLANO PREVIDENCIÁRIO

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	151.333.685,17	0,87	11,03	107,24	111,17	98,03	114,27		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	37.517.515,83	1,70	13,19	210,64	132,92	192,55	136,63		
FI Caixa Brasil IPCA XV Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	4.533.358,73	0,99	5,38	122,10	54,28	111,61	55,79		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	7.667,60	0,89	9,79	110,60	98,67	101,10	101,42		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	4.416.115,52	0,04	0,00	5,21	0,00	4,76	0,00		
TOTAL		197.808.342,85								

BANCO DO BRASIL S/A									
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	17.675.589,66	1,62	11,88	200,73	119,71	183,49	123,05	
TOTAL		17.675.589,66							

GWI CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.									
GWI Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.220.166,58	11,13	(21,07)	1.380,05	(212,38)		(0,36)	(5,24)
TOTAL		1.220.166,58							

BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A									
FIDC Aberto CPP540 RPPS	R.F.	3.724.682,84	1,05	11,87	130,03	119,69	118,86	123,03	
TOTAL		3.724.682,84							

TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO	220.428.781,93	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 31/10/2011							
---	-----------------------	---	--	--	--	--	--	--	--

TOTAL GERAL APLICADO - (R\$)	1.347.499.756,13	PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO							
-------------------------------------	-------------------------	--	--	--	--	--	--	--	--

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 31/10/2011

PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	365.613.704,96	32,41%	4.193.759,66
FUNDOS DE RENDA FIXA	579.727.183,53	51,40%	7.395.475,85
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	162.174.388,48	14,38%	13.462.465,46
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	19.555.697,23	1,73%	28.549,32
SALDO EM CONTAS CORRENTES	863.317,96	0,08%	
TOTAIS	1.127.934.292,16	100,00%	25.080.250,29

PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	151.333.685,17	68,65%	1.298.085,45
FUNDOS DE RENDA FIXA	63.458.814,66	28,79%	988.673,14
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	1.220.166,58	0,55%	122.242,24
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	4.416.115,52	2,00%	1.853,99
SALDO EM CONTAS CORRENTES	4.073,27	0,00%	
TOTAIS	220.432.855,20	100,00%	2.410.854,82

CONSOLIDAÇÃO DOS PLANO NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - OUTUBRO DE 2011 PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	516.947.390,13	38,34%	5.491.845,11
FUNDOS DE RENDA FIXA	643.185.998,19	47,70%	8.384.148,99
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	163.394.555,06	12,12%	13.584.707,70
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	23.971.812,75	1,78%	30.403,31
SALDO EM CONTAS CORRENTES	867.391,23	0,06%	
TOTAIS	1.348.367.147,36	100,00%	27.491.105,11

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 - OUTUBRO DE 2011					
INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL S/A	465.607.042,36	195.899,19	465.802.941,55	34,55%	6
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	298.099.623,69	4.277,80	298.103.901,49	22,11%	10
BANCO BRADESCO S/A	196.462.117,91	4.586,43	196.466.704,34	14,57%	5
ITAU UNIBANCO S/A	86.604.272,84	739,94	86.605.012,78	6,42%	3
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	107.283.348,47	4.013,06	107.287.361,53	7,96%	3
BANCO SANTANDER S/A	41.598.351,11	0,00	41.598.351,11	3,09%	1
BANCO PANAMERICANO S/A	14.534.536,54	0,00	14.534.536,54	1,08%	1
SCHROEDERS INVESTIMENT	29.510.337,95	0,00	29.510.337,95	2,19%	1
GWI CONSULT. PARTICIP. E SERV. LTDA.	2.969.697,14	0,00	2.969.697,14	0,22%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.230.850,25	0,00	2.230.850,25	0,17%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A	88.599.352,62	0,00	88.599.352,62	6,57%	3
BANCO BTG PACTUAL	14.000.225,25	657.874,81	14.658.100,06	1,09%	1
TOTAIS	1.347.499.756,13	867.391,23	1.348.367.147,36	100,00%	36

Em outubro 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(IGBE) + 6% a.a.	0,81	9,92	C.D.I.	0,88	9,65
RENDA FIXA	INPC(IGBE) + 6% a.a.	0,81	9,92	C.D.I.	0,88	9,65
RENDA VARIÁVEL	INPC(IGBE) + 6% a.a.	0,81	9,92	IBOVESPA	11,49	-15,82
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IGBE) + 6% a.a.	0,81	9,92	C.D.I.	0,88	9,65

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 outubro de 2011, distribuídos em 02 (duas) Carteira de Administradas de Títulos Públicos Federais e 34 (trinta e quatro) Fundos de Investimentos, sendo estes últimos distribuídos em 18 (dezoito) fundos de renda fixa, 11 (onze) fundos de renda variável e 05 (três) fundos multimercado.