

RELATÓRIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - ABRIL DE 2012

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO	E G M E N T O	VALOR R\$	RENTABILIDADE DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
			NO MÊS	NO ANO 2012	META ATUARIAL		META GERENCIAL			
					INPC + 6%a.a.		CDI		IBOVESPA	
					1,13	3,69	0,70	3,18	-4,17	8,93
		NO MÊS	NO ANO 2012	NO MÊS	NO ANO 2012	NO MÊS	NO ANO 2012			

PLANO FINANCEIRO

BANCO DO BRASIL S/A											
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)			58.163.938,90								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.		353.558.250,91	3,34	9,44	296,19	255,75	474,91	296,94		
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)			18.025.999,83								
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.		22.086.065,40	4,19	10,16	371,43	275,32	595,55	319,65		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.		3.680.972,54	0,66	2,99	58,57	81,01	93,91	94,05		
FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F - CAESB	R.F.		17.599.096,21	-1,68	-5,83	-149,07	-157,78	-239,02	-183,19		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA II	R.F.		12.908.119,84	0,76	3,26	67,83	88,44	108,76	102,68		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.		22.435.755,61	-4,50	7,50	-399,26	203,16			-0,33	-1,43
Brasil Ações IBBr Indexado FIC FI	R.V.		8.432.845,89	-3,00	7,65	-265,88	207,22			1,17	-1,28
TOTAL			516.891.045,13								

CAIXA ECONOMICA FEDERAL											
FI Caixa Brasil IPCA XI Renda Fixa Crédito Privado	R.F.		15.325.687,50	3,05	7,10	270,22	192,45	433,26	223,44		
FI Caixa Brasil IPCA XII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.		15.320.350,00	3,03	7,07	268,43	191,52	430,40	222,36		
FI Caixa Brasil IPCA XIII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.		14.843.500,00	2,88	6,99	255,38	189,43	409,48	219,93		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.		58.015,00	0,75	3,38	66,54	91,53	106,69	106,27		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.		58.685.834,76	4,33	10,51	383,94	284,81	615,60	330,67		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.		9.544.671,59	1,76	6,26	155,78	169,43	249,77	196,71		
FIDC da Companhia Estadual de Águas e Esgotos-CEDAE	R.F.		3.571.058,70	-1,01	-3,76	-89,81	-101,91	-144,01	-118,31		
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.		15.817.063,45	-3,64	5,12	-323,10	138,64			0,53	-3,81
FI Caixa Brasil IPCA V Multimercado Crédito Privado	M.M.		13.811.012,50	3,06	7,36	271,88	199,31	435,93	231,40		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.		5.078.050,40	0,00	7,29	0,00	197,34	0,00	229,12		
FI Caixa Brasil IPCA VIII Multimercado Crédito Privado	M.M.		4.559.586,06	3,09	6,70	274,59	181,48	440,27	210,70		
TOTAL			156.714.829,96								

BANCO BRADESCO S/A											
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.		141.047.187,25	0,00	10,53	0,00	285,28	0,00	331,22		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.		77.031.051,24	2,78	6,91	246,40	187,28	395,07	217,44		
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.		17.850.552,46	1,39	20,63	123,78	558,77			5,57	11,70
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.		1.127.711,99	0,91	3,51	80,60	95,02	129,2	110,32		
TOTAL			237.056.502,94								

ITAU UNIBANCO S/A											
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.		74.292.969,05	4,37	10,35	387,77	280,24	621,74	325,36		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.		10.315.427,12	1,68	6,16	148,67	166,86	238,37	193,72		
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.		35.368.398,51	-1,18	11,23	-104,71	304,32			2,99	2,31
Unibanco Equity Hedge FI Multimercado	M.M.		6.163,16	0,90	2,74	80,30	74,08	128,75	86,01		
TOTAL			119.982.957,84								

BANCO HSBC BANK BRASIL S/A											
Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo	R.F.		89.975.037,47	3,09	7,91	273,97	214,17	439,29	248,66		
Hsbc FI em Ações Ibovespa Top	R.V.		23.164.263,84	-4,22	8,05	-374,17	218,05			-0,05	-0,88
Hsbc FI Ações Setorial Ativo	R.V.		3.905.711,21	-1,51	12,89	-133,76	349,19			2,66	3,97
TOTAL			117.045.012,52								

BANCO SANTANDER S/A											
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.		58.490.844,76	4,33	10,32	384,10	279,48	615,87	324,48		
TOTAL			58.490.844,76								

SCHROEDERS INVESTMENT											
Schroder FI em Ações IBBr-50	R.V.		30.031.037,68	-4,68	5,34	-415,30	144,66			-0,51	-3,59
TOTAL			30.031.037,68								

GW CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.											
GW Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.		484.270,44	1,42	18,72	126,08	507,07			5,59	9,79
TOTAL			484.270,44								

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.											
BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.		2.398.010,92	-2,33	9,87	-206,54	267,28			1,84	0,94
TOTAL			2.398.010,92								

BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A											
FIDC Fechado BCSPul Verax Multicred Financeiro	R.F.		29.272.919,46	1,09	4,63	96,31	125,49	154,43	145,69		
FIDC Aberto CPP540 RPPS	R.F.		20.294.290,82	0,97	4,11	86,21	111,30	138,23	129,22		
TOTAL			49.567.210,28								

BANCO BTG PACTUAL											
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.		10.984.743,69	4,18	10,01	371,16	271,17	595,11	314,83		
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.		8.906.502,16	1,94	6,94	172,35	188,02	276,34	218,29		
BTG Pactual Dividendos FI de Ações	R.V.		22.959.084,78	2,52	15,20	223,29	411,84			6,69	6,28
TOTAL			42.850.330,63								

GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.											
Geração Futuro Dividendos FIA	R.V.		1.511.697,83	1,94	15,26	171,98	413,23			6,11	6,33
TOTAL			1.511.697,83								

QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.											
Queluz Valor Fundo de Investimento em Ações	R.V.		1.590.766,29	2,10	16,86	186,73	456,76			6,28	7,94
TOTAL			1.590.766,29								

PATRIA INVESTIMENTOS LTDA.											
Patria Special Opportunities I FIQ FI	R.V.		901.169,33	3,86	2,92	342,79	79,11			8,03	-6,01
TOTAL			901.169,33								

TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO			1.335.515.686,55							DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/04/2012	
---	--	--	-------------------------	--	--	--	--	--	--	---	--



PLANO PREVIDENCIÁRIO

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	154.130.530,39	0,73	3,42	65,15	92,65	104,46	107,57		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	60.348.190,85	4,33	10,51	383,94	284,81	615,60	330,67		
FI Caixa Brasil IPCA XV Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	5.014.163,76	3,00	7,17	266,24	194,08	426,88	225,33		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	8.069,98	0,75	3,38	66,54	91,53	106,69	106,27		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	4.873.009,25	3,02	7,29	268,33	197,34	430,23	229,12		
TOTAL		224.373.964,23								

BANCO DO BRASIL S/A										
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	21.446.240,83	4,19	10,16	371,43	275,32	595,55	319,65		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	3.503.437,46	0,66	2,99	58,57	81,01	93,91	94,05		
TOTAL		24.949.678,29								

GWI CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.										
GWI Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.397.362,31	1,42	18,72	126,08	507,07			5,59	9,79
TOTAL		1.397.362,31								

BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A										
FIDC Aberto CPP540 RPPS	R.F.	3.968.670,07	0,97	4,11	86,21	111,30	138,23	129,22		
TOTAL		3.968.670,07								

BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	8.621.503,03	1,94	6,94	172,35	188,02	276,34	218,29		
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	2.289.175,25	4,18	10,01	371,16	271,17	595,11	314,83		
TOTAL		10.910.678,28								

BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	3.116.020,43	4,48	10,53	397,45	285,28	637,27	331,22		
TOTAL		3.116.020,43								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	1.002.723,66	4,37	10,35	387,77	280,24	621,74	325,36		
TOTAL		1.002.723,66								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	1.956.045,49	4,33	10,32	384,10	279,48	615,87	324,48		
TOTAL		1.956.045,49								

TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO	271.675.142,76	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/04/2012
TOTAL GERAL APLICADO - (R\$)	1.607.190.829,31	PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 30/04/2012

PLANO FINANCEIRO

DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	429.748.189,64	31,97%	6.975.661,64
FUNDOS DE RENDA FIXA	694.334.344,56	51,66%	22.637.250,36
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	186.850.628,24	13,90%	-4.118.616,06
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	24.582.524,11	1,83%	706.725,01
SALDO EM CONTAS CORRENTES	8.563.730,50	0,64%	
TOTAIS	1.344.079.417,05	100,00%	26.201.020,95

PLANO PREVIDENCIÁRIO

DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	154.130.530,39	56,32%	1.123.426,10
FUNDOS DE RENDA FIXA	111.274.240,81	40,66%	3.938.744,22
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	1.397.362,31	0,51%	19.577,55
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	4.873.009,25	1,78%	143.035,32
SALDO EM CONTAS CORRENTES	1.994.392,39	0,73%	
TOTAIS	273.669.535,15	100,00%	5.224.783,19

CONSOLIDAÇÃO DOS PLANO NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - ABRIL DE 2012
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO

DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	583.878.720,03	36,09%	8.099.087,74
FUNDOS DE RENDA FIXA	805.608.585,37	49,80%	26.575.994,58
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	188.247.990,55	11,64%	-4.099.038,51
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	29.455.533,36	1,82%	849.760,33
SALDO EM CONTAS CORRENTES	10.558.122,89	0,65%	
TOTAIS	1.617.748.952,20	100,00%	31.425.804,14

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 - ABRIL DE 2012

INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL S/A	541.840.723,42	10.547.521,60	552.388.245,02	34,15%	7
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	381.088.794,19	5.770,36	381.094.564,55	23,56%	13
BANCO BRADESCO S/A	240.172.523,37	0,00	240.172.523,37	14,85%	4
ITAU UNIBANCO S/A	120.985.681,50	832,60	120.986.514,10	7,48%	4
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	117.045.012,52	3.998,31	117.049.010,83	7,24%	3
BANCO SANTANDER S/A	60.446.890,25	0,00	60.446.890,25	3,74%	1
SCHROEDERS INVESTMENT	30.031.037,68	0,00	30.031.037,68	1,86%	1
GWI CONSULT. PARTICIP. E SERV. LTDA.	1.881.632,75	0,00	1.881.632,75	0,12%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.398.010,92	0,00	2.398.010,92	0,15%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A	53.535.880,35	0,00	53.535.880,35	3,31%	2
BANCO BTG PACTUAL	53.761.008,91	0,02	53.761.008,93	3,32%	3
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.	1.511.697,83	0,00	1.511.697,83	0,09%	1
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.	1.590.766,29	0,00	1.590.766,29	0,10%	1
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA	901.169,33	0,00	901.169,33	0,06%	1
TOTAIS	1.607.190.829,31	10.558.122,89	1.617.748.952,20	100,00%	43

Em abril de 2012, os índices para atingimento das metas, atuarial e gerencial, são os seguintes:

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	ÍNDICE	ABR/12	2012	ÍNDICE	ABR/12	2012



TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,13	3,69	C.D.I.	0,70	3,18
RENDA FIXA	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,13	3,69	C.D.I.	0,70	3,18
RENDA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,13	3,69	IBOVESPA	-4,17	8,93
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,13	3,69	C.D.I.	0,70	3,18

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 março de 2012, distribuídos em 02 (duas) Carteira de Administradas de Títulos Públicos Federais e 41 (quarenta e um) Fundos de Investimentos, sendo estes últimos distribuídos em 22 (vinte e dois) fundos de renda fixa, 14 (catorze) fundos de renda variável e 05 (cinco) fundos multimercado.