

RELATÓRIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - FEVEREIRO DE 2012

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO	E G M E N T O	VALOR R\$	RENTABILIDADE DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
					META ATUARIAL		META GERENCIAL			
					INPC + 6%a.a.		CDI		IBOVESPA	
					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)	R.F.	33.899.264,01	2,21	4,07	252,47	216,57	298,44	248,66		
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	354.959.208,50								
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	19.683.988,94	2,18	3,78	248,41	201,57	293,64	231,43		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	6.629.644,32	0,69	1,52	78,67	80,84	92,99	92,82		
FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F - CAESB	R.F.	18.168.250,53	0,00	1,13	0,00	60,18	0,00	69,10		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA II	R.F.	12.687.371,43	0,90	1,50	102,60	79,83	121,28	91,66		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	24.051.187,63	4,27	15,24	487,37	811,64			(0,07)	(0,72)
Brasil Ações IBrX Indexado FIC FI	R.V.	8.742.147,50	3,35	11,60	381,66	617,69			(1,00)	(4,36)
TOTAL		478.821.062,86								

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
FI Caixa Brasil IPCA XI Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	14.636.962,50	0,90	2,29	102,69	122,05	121,39	140,13		
FI Caixa Brasil IPCA XII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	14.635.712,50	0,90	2,29	102,53	121,73	121,20	139,77		
FI Caixa Brasil IPCA XIII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	14.286.225,00	0,93	2,29	106,25	121,82	125,59	139,87		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	57.058,28	0,76	1,67	86,55	89,17	102,31	102,38		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	46.475.624,78	2,35	3,98	267,65	211,90	316,38	243,29		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	9.279.707,91	1,44	3,31	164,73	176,03	194,73	202,11		
FIDC da Companhia Estadual de Águas e Esgotos-CEDAE	R.F.	3.637.367,16	(1,03)	(1,98)	(117,01)	(105,19)	(138,31)	(120,78)		
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	16.673.707,81	2,60	10,81	296,61	575,77			(1,74)	(5,15)
FI Caixa Brasil IPCA V Multimercado Crédito Privado	M.M.	13.170.587,50	1,00	2,38	113,92	126,74	134,66	145,52		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	4.845.226,00	0,99	2,37	113,40	126,03	134,04	144,71		
FI Caixa Brasil IPCA VIII Multimercado Crédito Privado	M.M.	4.359.687,77	0,99	2,02	113,01	107,69	133,58	123,64		
TOTAL		142.057.867,21								

BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	124.381.662,31	2,26	3,81	257,88	202,86	304,83	232,92		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	73.978.302,03	1,39	2,68	158,24	142,57	187,05	163,70		
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.	16.267.188,40	7,94	15,15	905,83	806,83			3,60	(0,81)
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	1.108.305,70	0,77	1,73	87,76	91,95	103,7	105,58		
Bradesco FIC FI Multimercado Golden Profit Moderado	M.M.	408,66	1,44	4,53	164,40	241,30	194,33	277,05		
TOTAL		215.735.867,10								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	64.764.622,26	2,14	3,77	244,26	200,93	288,73	230,70		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	10.037.630,41	1,44	3,30	164,28	175,80	194,20	201,85		
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	35.947.312,25	4,89	13,06	557,63	695,28			0,55	(2,90)
Unibanco Equity Hedge FI Multimercado	M.M.	6.030,49	0,66	0,52	75,18	27,88	88,87	32,01		
TOTAL		110.755.595,41								

BANCO HSBC BANK BRASIL S/A										
Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo	R.F.	86.074.469,20	1,77	3,23	201,81	171,96	238,56	197,44		
Hsbc FI em Ações Ibovespa Top	R.V.	24.714.828,02	4,08	15,28	464,91	813,89			(0,27)	(0,68)
Hsbc Fi Ações Setorial Ativo	R.V.	3.998.719,56	3,42	15,58	389,91	829,71			(0,93)	(0,38)
TOTAL		114.788.016,78								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	44.841.266,73	2,19	3,75	249,94	199,73	295,45	229,33		
TOTAL		44.841.266,73								

SCHRODERS INVESTIMENT										
Schroder FI em Ações IBrX-50	R.V.	32.105.096,88	2,23	12,62	254,59	671,86			(2,11)	(3,34)
TOTAL		32.105.096,88								

GWJ CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.										
GWJ Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	477.456,78	9,35	17,05	1.066,00	908,00			5,00	1,09
TOTAL		477.456,78								

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.										
BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.469.087,21	3,63	13,12	414,58	698,92			(0,71)	(2,84)
TOTAL		2.469.087,21								

BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A										
FIDC Aberto BCSul Verax CPP360	R.F.	53.207.279,73	0,83	1,83	94,80	97,65	112,06	112,12		
FIDC Fechado BCSul Verax Multicred Financeiro	R.F.	28.640.677,96	1,08	2,37	122,92	126,37	145,30	145,10		
TOTAL		81.847.957,69								

BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	8.705.546,57	1,76	1,88	200,92	100,00	237,50	114,82		
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	7.104.486,56	1,69	3,73	192,28	198,73	227,29	228,17		
BTG Pactual Dividendos FI de Ações	R.V.	19.621.948,22	7,03	8,50	802,04	452,52			2,69	(7,46)
TOTAL		35.431.981,35								

GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.										
Geração Futuro Dividendos FIA	R.V.	719.549,27	4,72	12,00	538,28	639,13			0,38	(3,96)
TOTAL		719.549,27								

QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.										
Queluz Valor Fundo de Investimento em Ações	R.V.	721.463,70	6,89	10,10	786,23	538,10			2,55	(5,86)
TOTAL		721.463,70								

TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO	1.260.772.268,97	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 29/02/2012
---	-------------------------	---

PLANO PREVIDENCIÁRIO

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	151.575.468,59	0,70	1,71	79,51	90,87	93,98	104,33		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	49.017.468,72	2,35	3,98	267,65	211,90	316,38	243,29		



AMAPÁ PREVIDÊNCIA - AMPREV
DIRETORIA FINANCEIRA E ATUARIAL - DIFAT
DIVISÃO DE CONTROLE ATUARIAL E MERCADO - DICAM

FI Caixa Brasil IPCA XV Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	4.787.569,82	0,94	2,32	106,68	123,67	126,10	142,00		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	7.936,90	0,76	1,67	86,55	89,17	102,31	102,38		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	4.649.585,81	0,99	2,37	113,40	126,03	134,04	144,71		
TOTAL		210.038.029,84								
BANCO DO BRASIL S/A										
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	18.562.946,31	2,18	3,78	248,41	201,57	293,64	231,43		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	1.683.669,45	0,69	1,52	78,67	80,84	92,99	92,82		
TOTAL		20.246.615,76								
GWI CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.										
GWI Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.377.701,51	9,35	17,05	1.066,00	908,00			5,00	1,09
TOTAL		1.377.701,51								
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A										
FIDC Aberto CPP540 RPPS	R.F.	3.892.465,25	0,96	2,11	109,54	112,37	129,49	129,02		
TOTAL		3.892.465,25								
BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	8.362.738,24	1,69	3,73	192,28	198,73	227,29	228,17		
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	1.792.064,48	1,76	3,71	200,92	197,81	237,50	227,13		
TOTAL		10.154.802,72								
BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	944.398,96	2,26	3,81	257,88	202,86	304,83	232,92		
TOTAL		944.398,96								
TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO		246.654.014,04								DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 29/02/2012
TOTAL GERAL APLICADO - (R\$)		1.507.426.283,01								PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 29/02/2012

PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	388.858.472,51	30,52%	8.448.887,51
FUNDOS DE RENDA FIXA	661.913.857,11	51,96%	11.005.037,24
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	186.509.693,23	14,64%	7.952.385,82
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	23.490.246,12	1,84%	229.204,92
SALDO EM CONTAS CORRENTES	13.201.360,05	1,04%	
TOTAIS	1.273.973.629,02	100,00%	27.635.515,49

PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	151.575.468,59	60,37%	1.079.750,14
FUNDOS DE RENDA FIXA	89.051.258,13	35,47%	1.735.549,32
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	1.377.701,51	0,55%	117.747,21
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	4.649.585,81	1,85%	45.767,06
SALDO EM CONTAS CORRENTES	4.436.024,68	1,77%	
TOTAIS	251.090.038,72	100,00%	2.978.813,73

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

DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	540.433.941,10	35,44%	9.528.637,65
FUNDOS DE RENDA FIXA	750.965.115,24	49,24%	12.740.586,56
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	187.887.394,74	12,32%	8.070.133,03
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	28.139.831,93	1,85%	274.971,98
SALDO EM CONTAS CORRENTES	17.637.384,73	1,16%	
TOTAIS	1.525.063.667,74	100,00%	30.614.329,22

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 - FEVEREIRO DE 2012

INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL S/A	499.067.678,62	13.195.343,47	512.263.022,09	33,59%	7
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	352.095.897,05	4.432.716,56	356.528.613,61	23,38%	13
BANCO BRADESCO S/A	216.680.266,06	4.586,43	216.684.852,49	14,21%	5
ITAU UNIBANCO S/A	110.755.595,41	739,94	110.756.335,35	7,26%	4
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	114.788.016,78	3.998,31	114.792.015,09	7,53%	3
BANCO SANTANDER S/A	44.841.266,73	0,00	44.841.266,73	2,94%	1
SCHROEDERS INVESTIMENT	32.105.096,88	0,00	32.105.096,88	2,11%	1
GWI CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.	1.855.158,29	0,00	1.855.158,29	0,12%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.469.087,21	0,00	2.469.087,21	0,16%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A	85.740.422,94	0,00	85.740.422,94	5,62%	3
BANCO BTG PACTUAL	45.586.784,07	0,02	45.586.784,09	2,99%	3
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.	719.549,27	0,00	719.549,27	0,05%	1
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.	721.463,70	0,00	721.463,70	0,05%	1
TOTAIS	1.507.426.283,01	17.637.384,73	1.525.063.667,74	100,00%	44

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

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	ÍNDICE	FEV/12	2012	ÍNDICE	FEV/12	2012
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(ÍBGE) + 6% a.a.	0,88	1,88	C.D.I.	0,74	1,64
RENDA FIXA	INPC(ÍBGE) + 6% a.a.	0,88	1,88	C.D.I.	0,74	1,64
RENDA VARIÁVEL	INPC(ÍBGE) + 6% a.a.	0,88	1,88	IBOVESPA	4,34	15,96
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(ÍBGE) + 6% a.a.	0,88	1,88	C.D.I.	0,74	1,64

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 fevereiro de 2012, distribuídos em 02 (duas) Carteira de Administradas de Títulos Públicos Federais e 42 (quarenta e dois) Fundos de Investimentos, sendo estes últimos distribuídos em 23 (vinte e três) fundos de renda fixa, 13 (treze) fundos de renda variável e 06 (seis) fundos multimercado.