

RELATORIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - JANEIRO 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	NO MÊS	NO ANO 2012		

PLANO FINANCEIRO

BANCO DO BRASIL S/A											
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)			33.278.132,04	1,81	1,81	181,92	181,92	204,38	204,38		
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.		347.133.828,48								
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.		20.937.143,38	1,57	1,57	157,81	157,81	177,29	177,29		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.		3.115.449,89	0,82	0,82	82,54	82,54	92,73	92,73		
FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F - CAESB	R.F.		18.448.989,91	1,13	1,13	113,37	113,37	127,37	127,37		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA II	R.F.		12.574.271,73	0,59	0,59	59,61	59,61	66,97	66,97		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.		23.065.664,57	10,52	10,52	1.055,30	1.055,30			(0,61)	(0,61)
Brasil Ações IBrX Indexado FIC FI	R.V.		8.459.115,33	7,99	7,99	801,18	801,18			(3,15)	(3,15)
TOTAL			467.012.595,33								

CAIXA ECONOMICA FEDERAL											
FI Caixa Brasil IPCA XI Renda Fixa Crédito Privado	R.F.		14.506.362,50	1,38	1,38	138,36	138,36	155,44	155,44		
FI Caixa Brasil IPCA XII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.		14.505.325,00	1,37	1,37	137,91	137,91	154,94	154,94		
FI Caixa Brasil IPCA XIII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.		14.154.387,50	1,34	1,34	134,79	134,79	151,43	151,43		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.		56.628,58	0,91	0,91	91,16	91,16	102,42	102,42		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.		43.003.638,42	1,60	1,60	160,03	160,03	179,78	179,78		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.		7.560.385,41	1,83	1,83	184,07	184,07	206,80	206,80		
FIDC da Companhia Estadual de Águas e Esgotos-CEDAE	R.F.		3.675.065,27	(0,96)	(0,96)	(96,24)	(96,24)	(108,12)	(108,12)		
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.		16.251.128,62	8,00	8,00	802,94	802,94			(3,13)	(3,13)
FI Caixa Brasil IPCA V Multimercado Crédito Privado	M.M.		13.040.350,00	1,37	1,37	137,19	137,19	154,13	154,13		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.		4.797.533,20	1,36	1,36	136,34	136,34	153,17	153,17		
FI Caixa Brasil IPCA VIII Multimercado Crédito Privado	M.M.		4.316.920,31	1,02	1,02	102,46	102,46	115,11	115,11		
TOTAL			135.867.724,81								

BANCO BRADESCO S/A											
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.		121.631.853,86	1,51	1,51	151,91	151,91	170,67	170,67		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.		72.966.111,33	1,27	1,27	127,65	127,65	143,41	143,41		
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.		15.070.422,15	6,68	6,68	670,06	670,06			(4,45)	(4,45)
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.		1.099.843,84	0,95	0,95	95,31	95,31	107,1	107,08		
Bradesco FIC FI Multimercado Golden Profit Moderado	M.M.		402,85	3,05	3,05	305,59	305,59	343,31	343,31		
TOTAL			210.768.634,03								

ITAU UNIBANCO S/A											
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.		61.811.064,00	1,60	1,60	160,26	160,26	180,05	180,05		
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.		34.271.886,53	7,79	7,79	781,20	781,20			(3,35)	(3,35)
Unibanco Equity Hedge FI Multimercado	M.M.		5.991,00	(0,13)	(0,13)	(13,52)	(13,52)	(15,19)	(15,19)		
TOTAL			96.088.941,53								

BANCO HSBC BANK BRASIL S/A											
Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo	R.F.		84.578.081,34	1,43	1,43	143,91	143,91	161,68	161,68		
Hsbc FI em Ações Ibovespa Top	R.V.		23.746.972,36	10,77	10,77	1.080,37	1.080,37			(0,36)	(0,36)
Hsbc FI Ações Setorial Ativo	R.V.		3.866.551,03	11,76	11,76	1.179,84	1.179,84			0,63	0,63
TOTAL			112.191.604,73								

BANCO SANTANDER S/A											
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.		43.879.792,39	1,53	1,53	153,09	153,09	171,99	171,99		
TOTAL			43.879.792,39								

BANCO PANAMERICANO S/A											
Caixa FIDC Master GDC Veículos do Banco Panamericano	R.F.		0,00	0,99	0,99	99,76	99,76	112,07	112,07		
TOTAL			0,00								

SCHROEDERS INVESTMENT											
Schroder FI em Ações IBrX-50	R.V.		31.404.178,91	10,16	10,16	1.019,07	1.019,07			(0,98)	(0,98)
TOTAL			31.404.178,91								

GW CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.											
GW Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.		1.806.580,02	7,05	7,05	706,93	706,93			(4,09)	(4,09)
TOTAL			1.806.580,02								

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.											
BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.		2.382.494,25	9,16	9,16	918,67	918,67			(1,98)	(1,98)
TOTAL			2.382.494,25								

BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A											
FIDC Aberto BCSul Verax CPP360	R.F.		52.768.721,78	0,99	0,99	99,76	99,76	112,07	112,07		
FIDC Fechado BCSul Verax Multicred Financeiro	R.F.		28.335.340,89	1,28	1,28	128,58	128,58	144,45	144,45		
TOTAL			81.104.062,67								

BANCO BTG PACTUAL											
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.		7.516.129,79	1,92	1,00	192,55	100,00	216,32	112,34		
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.		4.582.751,50	2,01	2,01	201,86	201,86	226,78	226,78		
BTG Pactual Dividendos FI de Ações	R.V.		18.332.904,64	1,37	1,37	137,40	137,40			(9,76)	(9,76)
TOTAL			30.431.785,93								

GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.											
Geração Futuro Dividendos FIA	R.V.		687.124,07	6,95	6,95	697,70	697,70			(4,18)	(4,18)
TOTAL			687.124,07								

QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.											
Queluz Valor Fundo de Investimento em Ações	R.V.		674.942,12	3,00	3,00	301,43	301,43			(8,13)	(8,13)
TOTAL			674.942,12								

TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO			1.214.300.460,79								
---	--	--	-------------------------	--	--	--	--	--	--	--	--

PLANO PREVIDENCIÁRIO

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	154.924.157,21	1,00	1,00	100,56	100,56	112,97	112,97		
FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	45.845.659,65	1,60	1,60	160,03	160,03	179,78	179,78		
FI Caixa Brasil IPCA XV Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	4.743.210,32	1,37	1,37	137,87	137,87	154,89	154,89		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	7.877,13	0,91	0,91	91,16	91,16	102,42	102,42		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	4.603.818,75	1,36	1,36	136,34	136,34	153,17	153,17		
TOTAL		210.124.723,06								

BANCO DO BRASIL S/A										
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	18.371.143,07	1,57	1,57	157,81	157,81	177,29	177,29		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	611.428,73	0,82	0,82	82,54	82,54	92,73	92,73		
TOTAL		18.982.571,80								

GWI CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.										
GWI Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.259.954,30	7,05	7,05	706,93	706,93			(4,09)	(4,09)
TOTAL		1.259.954,30								

BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A										
FIDC Aberto CPP540 RPPS	R.F.	3.855.440,93	1,14	1,14	114,25	114,25	128,36	128,36		
TOTAL		3.855.440,93								

BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	6.162.521,71	2,01	2,01	201,86	201,86	226,78	226,78		
TOTAL		6.162.521,71								

TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO 240.385.211,80 DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 31/01/2012

TOTAL GERAL APLICADO - (R\$) 1.454.685.672,59 PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 31/01/2012

PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	380.411.960,52	31,32%	6.807.075,95
FUNDOS DE RENDA FIXA	630.607.494,47	51,91%	8.703.397,67
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	180.019.964,60	14,82%	13.635.619,55
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	23.261.041,20	1,91%	298.743,61
SALDO EM CONTAS CORRENTES	457.373,88	0,04%	
TOTAIS	1.214.757.834,67	100,00%	29.444.836,78

PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	154.924.157,21	64,45%	1.537.328,89
FUNDOS DE RENDA FIXA	79.597.281,54	33,11%	1.197.428,07
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	1.259.954,30	0,52%	82.933,73
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	4.603.818,75	1,92%	61.724,62
SALDO EM CONTAS CORRENTES	4.600,36	0,00%	
TOTAIS	240.389.812,16	100,00%	2.879.415,31

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

DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	535.336.117,73	36,79%	8.344.404,84
FUNDOS DE RENDA FIXA	710.204.776,01	48,81%	9.900.825,74
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	181.279.918,90	12,46%	13.718.553,28
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	27.864.859,95	1,91%	360.468,23
SALDO EM CONTAS CORRENTES	461.974,24	0,03%	
TOTAIS	1.455.147.646,83	100,00%	32.324.252,09

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 - JANEIRO DE 2012

INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL S/A	485.995.167,13	448.365,84	486.443.532,97	33,43%	7
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	345.992.447,87	4.277,80	345.996.725,67	23,78%	13
BANCO BRADESCO S/A	210.768.634,03	4.586,43	210.773.220,46	14,48%	5
ITAU UNIBANCO S/A	96.088.941,53	739,94	96.089.681,47	6,60%	3
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	112.191.604,73	4.004,21	112.195.608,94	7,71%	3
BANCO SANTANDER S/A	43.879.792,39	0,00	43.879.792,39	3,02%	1
BANCO PANAMERICANO S/A	0,00	0,00	0,00	0,00%	1
SCHRODERS INVESTIMENT	31.404.178,91	0,00	31.404.178,91	2,16%	1
GWI CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.	3.066.534,32	0,00	3.066.534,32	0,21%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.382.494,25	0,00	2.382.494,25	0,16%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A	84.959.503,60	0,00	84.959.503,60	5,84%	3
BANCO BTG PACTUAL	36.594.307,64	0,02	36.594.307,66	2,51%	3
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.	687.124,07	0,00	687.124,07	0,05%	1
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.	674.942,12	0,00	674.942,12	0,05%	1
TOTAIS	1.454.685.672,59	461.974,24	1.455.147.646,83	100,00%	44

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

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	ÍNDICE	JAN/12	2012	ÍNDICE	JAN/12	2012
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,00	1,00	C.D.I.	0,89	0,89
RENDA FIXA	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,00	1,00	C.D.I.	0,89	0,89
RENDA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,00	1,00	IBOVESPA	11,13	11,13
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,00	1,00	C.D.I.	0,89	0,89

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 janeiro 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.