

RELATÓRIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV
CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - SETEMBRO DE 2012

ALOCACÃO 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	
					1,12	8,58	0,54	6,60	3,71	4,27
			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)		35.459.550,49								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	438.085.646,92	1,61	17,32	143,94	201,85	299,22	262,23		
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)		1.336.620,19								
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	18.443.064,23	1,37	18,48	122,21	215,44	254,06	279,88		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	3.118.199,95	0,48	6,09	42,80	71,03	88,97	92,28		
FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F. - CAESB	R.F.	15.955.120,90	-2,26	-14,62	-202,33	-170,44	-420,60	-221,43		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA II	R.F.	13.451.467,67	0,87	7,78	78,17	90,73	162,49	117,88		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	21.148.679,43	3,43	1,33	307,10	15,54			-0,28	-2,93
Brasil Ações IBRX Indexado FIC FI	R.V.	8.104.267,96	2,78	3,46	249,19	40,28			-0,92	-0,81
TOTAL		555.102.617,74								

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
FI Caixa Brasil IPCA XI Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	16.201.850,00	0,78	13,23	70,03	154,19	145,58	200,31		
FI Caixa Brasil IPCA XII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	16.193.287,50	0,78	13,17	69,82	153,53	145,14	199,46		
FI Caixa Brasil IPCA XIII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	15.782.212,50	0,70	13,00	62,92	151,51	130,79	196,84		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	59.915,58	0,53	6,77	47,17	78,86	98,05	102,46		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	77.151.867,10	1,29	18,89	115,24	220,20	239,57	286,07		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	10.056.891,49	1,60	11,96	143,33	139,38	297,96	181,07		
FIDC da Companhia Estadual de Águas e Esgotos-CEDAE	R.F.	3.404.559,37	-1,05	-8,25	-94,06	-96,16	-195,54	-124,92		
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	15.687.911,65	3,83	4,26	342,54	49,66			0,12	-0,01
Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS	R.V.	9.984.502,45	-3,34	0,00	-298,69	0,00			-7,04	-4,27
FI Caixa Brasil IPCA V Multimercado Crédito Privado	M.M.	14.895.325,00	0,71	15,79	63,45	184,02	131,90	239,06		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	5.472.873,00	0,71	15,63	63,18	182,15	131,35	236,64		
FI Caixa Brasil IPCA VIII Multimercado Crédito Privado	M.M.	4.924.497,07	0,68	15,24	61,18	177,63	127,18	230,77		
TOTAL		189.815.692,71								

BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	166.329.725,20	1,42	19,46	127,12	226,78	264,26	294,62		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	83.475.240,20	1,02	13,87	91,61	161,70	190,45	210,07		
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.	17.580.290,40	0,07	18,80	6,56	219,17			-3,63	14,54
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	2.037.654,66	0,53	16,72	47,13	194,87			-3,18	12,45
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	1.169.311,78	0,59	7,33	53,04	85,40	110,3	110,94		
TOTAL		270.592.222,24								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	87.376.331,86	1,40	18,74	125,31	218,41	260,49	283,74		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	10.566.232,77	1,61	11,88	143,81	138,48	298,95	179,90		
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	35.635.347,02	1,90	12,07	170,32	140,74			-1,80	7,81
FIC FIP Kinea Private Equity II	R.V.	289.185,31	-3,60	0,00	-322,73	0,00			-7,31	-4,27
Unibanco Equity Hedge FI Multimercado	M.M.	6.488,91	1,77	8,16	158,20	95,17	328,86	123,64		
TOTAL		133.873.585,87								

BANCO HSBC BANK BRASIL S/A										
Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo	R.F.	97.458.997,46	1,45	15,16	129,94	176,75	270,12	229,62		
Hsbc FI em Ações Ibovespa Top	R.V.	22.002.274,51	3,48	2,63	311,72	30,66			-0,22	-1,64
Hsbc FI Ações Setorial Ativo	R.V.	3.804.068,06	3,87	9,95	346,18	116,02			0,16	5,69
TOTAL		123.265.340,03								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	63.916.994,78	1,36	18,64	121,87	217,30	253,34	282,30		
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	8.167.964,51	1,37	18,79	123,00	219,08	255,70	284,61		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	1.508.466,33	0,19	16,46	16,96	191,82			-3,52	12,19
TOTAL		73.593.425,62								

SCHRODERS INVESTMENT										
Schroder FI em Ações IBRX-50	R.V.	29.073.634,94	3,71	1,98	331,79	23,11			0,00	-2,28
TOTAL		29.073.634,94								

GW CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.										
GW Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	542.727,27	8,57	33,05	767,39	385,25			4,87	28,78
TOTAL		542.727,27								

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.										
BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.393.759,57	1,71	9,67	153,47	112,75			-1,99	5,41
TOTAL		2.393.759,57								

BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A										
FIDC Aberto CPP540 RPPS	R.F.	18.134.588,59	0,25	7,70	22,69	89,77	47,18	116,62		
TOTAL		18.134.588,59								

BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	18.697.666,54	1,55	18,73	138,56	218,30	288,03	283,60		
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	9.406.813,56	1,81	10,94	162,28	127,49	337,35	165,63		
BTG Pactual Dividendos FI de Ações	R.V.	22.512.858,13	-2,67	12,97	-238,71	151,13			-6,37	8,70
TOTAL		50.617.338,23								

GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.										
Geração Futuro Dividendos FIA	R.V.	1.432.366,68	-0,92	8,21	-82,72	95,68			-4,63	3,94
TOTAL		1.432.366,68								

QUELUZ GESTAO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.										
Queluz Valor Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.603.447,15	2,89	17,79	258,80	207,41			-0,81	13,53
TOTAL		1.603.447,15								

PATRIA INVESTIMENTOS LTDA.										
Patria Special Opportunities I FIQ FI	R.V.	1.131.197,15	1,45	3,08	130,24	35,91			-2,25	-1,19
TOTAL		1.131.197,15								

TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO		1.451.171.943,79			DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 28/09/2012					
---	--	-------------------------	--	--	---	--	--	--	--	--

PLANO PREVIDENCIÁRIO										
CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	159.915.498,51	0,00	6,87	0,00	80,12	0,00	104,08		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	74.398.952,19	1,29	18,89	115,24	220,20	239,57	286,07		
FI Caixa Brasil IPCA XV Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	5.293.677,67	0,70	13,14	62,30	153,15	129,52	198,97		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	8.334,35	0,53	6,77	47,17	78,86	98,05	102,46		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	5.251.889,73	0,71	15,63	63,18	182,15	131,35	236,64		
TOTAL		244.868.352,45								
BANCO DO BRASIL S/A										
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	22.938.475,42	1,37	18,48	122,21	215,44	254,06	279,88		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	1.677.601,51	0,48	6,09	42,80	71,03	88,97	92,28		
TOTAL		24.616.076,93								
GWÍ CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.										
GWÍ Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.566.039,50	8,57	33,05	767,39	385,25			4,87	28,78
TOTAL		1.566.039,50								
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A										
FIDC Aberto CPP540 RPPS	R.F.	0,00	0,25	7,97	22,69	92,95	47,18	120,75		
TOTAL		0,00								
BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	10.259.417,91	1,81	12,95	162,28	150,93	337,35	196,08		
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	3.275.772,36	1,55	18,73	138,56	218,30	288,03	283,60		
TOTAL		13.535.190,27								
BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	10.556.452,35	1,42	19,46	127,12	226,78	264,26	294,62		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	1.153.518,30	1,02	13,87	91,61	161,70	190,45	210,07		
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	703.715,91	0,53	0,00	47,13	0,00			-3,18	-4,27
TOTAL		12.413.686,56								
ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	1.865.937,79	1,40	18,74	125,31	218,41	260,49	283,74		
TOTAL		1.865.937,79								
BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	2.892.630,07	1,36	18,64	121,87	217,30	253,34	282,30		
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	212.775,73	1,37	18,79	123,00	219,08	255,70	284,61		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	697.306,09	0,19	0,00	16,96	0,00			-3,52	-4,27
TOTAL		3.802.711,89								
TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO		302.667.995,39								
TOTAL GERAL APLICADO - (R\$)		1.753.839.939,18								
DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 28/09/2012										
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO										

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 28/09/2012			
PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	474.881.817,60	32,72%	7.131.125,20
FUNDOS DE RENDA FIXA	753.348.991,76	51,91%	9.574.401,49
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	196.472.638,67	13,54%	3.269.290,39
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	26.468.495,76	1,82%	183.603,19
SALDO EM CONTAS CORRENTES	18.458,62	0,00%	
TOTAIS	1.451.190.402,41	100,00%	20.158.420,27

PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	159.915.498,51	52,83%	1.661.393,25
FUNDOS DE RENDA FIXA	134.533.545,65	44,45%	1.753.705,46
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	2.967.061,50	0,98%	128.642,02
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	5.251.889,73	1,74%	36.806,12
SALDO EM CONTAS CORRENTES	7.894,77	0,00%	
TOTAIS	302.675.890,16	100,00%	3.580.546,85

CONSOLIDAÇÃO DOS PLANOS NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - SETEMBRO DE 2012			
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	634.797.316,11	36,19%	8.792.518,45
FUNDOS DE RENDA FIXA	887.882.537,41	50,62%	11.328.106,95
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	199.439.700,17	11,37%	3.397.932,41
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	31.720.385,49	1,81%	220.409,31
SALDO EM CONTAS CORRENTES	26.353,39	0,00%	
TOTAIS	1.753.866.292,57	100,00%	23.738.967,12

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 - SETEMBRO DE 2012					
INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL S/A	579.718.694,67	17.220,82	579.735.915,49	33,05%	7
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	434.684.045,16	4.264,30	434.688.309,46	24,78%	14
BANCO BRADESCO S/A	283.005.908,80	0,00	283.005.908,80	16,14%	5
ITAU UNIBANCO S/A	135.739.523,66	869,94	135.740.393,60	7,74%	5
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	123.265.340,03	3.998,31	123.269.338,34	7,03%	3
BANCO SANTANDER S/A	77.396.137,51	0,00	77.396.137,51	4,41%	3
SCHROEDERS INVESTMENT	29.073.634,94	0,00	29.073.634,94	1,66%	1
GWÍ CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.	2.108.766,77	0,00	2.108.766,77	0,12%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.393.759,57	0,00	2.393.759,57	0,14%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A	18.134.588,59	0,00	18.134.588,59	1,03%	3
BANCO BTG PACTUAL	64.152.528,50	0,02	64.152.528,52	3,66%	3
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.	1.432.366,68	0,00	1.432.366,68	0,08%	1
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.	1.603.447,15	0,00	1.603.447,15	0,09%	1
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA	1.131.197,15	0,00	1.131.197,15	0,06%	1
TOTAIS	1.753.839.939,18	26.353,39	1.753.866.292,57	100,00%	49

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

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	INDICE	SET/12	2012	INDICE	SET/12	2012
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,12	8,58	C.D.I.	0,54	6,60
RENTA FIXA	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,12	8,58	C.D.I.	0,54	6,60
RENTA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,12	8,58	IBOVESPA	3,71	4,27
RENTA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,12	8,58	C.D.I.	0,54	6,60

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 setembro de 2012, distribuídos em 02 (duas) Carteira de Administradas de Títulos Públicos Federais e 47 (quarenta e sete) Fundos de Investimentos, sendo estes últimos distribuídos em 24 (vinte e quatro) fundos de renda fixa, 18 (dezoito) fundos de renda variável e 05 (cinco) fundos multimercado.