

RELATÓRIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV
CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - JANEIRO DE 2013

ALOCACÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO	E G M E N T O	VALOR R\$	RENTABILIDADE DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
					META ATUARIAL		META GERENCIAL			
			NO MÊS	NO ANO 2013	INPC + 6%a.a.		CDI		IBOVESPA	
					1,41	1,41	0,59	0,59	-1,95	-1,95
					NO MÊS	NO ANO 2013	NO MÊS	NO ANO 2013	NO MÊS	NO ANO 2013

PLANO FINANCEIRO

BANCO DO BRASIL S/A										
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)		25.022.525,49								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	476.035.938,58	0,55	0,55	38,89	38,89	93,29	93,29		
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)		5.029.376,80								
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	10.357.505,93	0,51	0,51	36,21	36,21	86,85	86,85		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	13.460.605,38	0,52	0,52	37,15	37,15	89,12	89,12		
FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F - CAESB	R.F.	14.445.643,26	-2,59	-2,59	-184,11	-184,10	-441,61	-441,60		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA II	R.F.	14.088.121,87	1,42	1,42	100,66	100,66	241,46	241,46		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	21.124.701,58	-2,39	-2,39	-169,75	-169,75			-0,43	-0,43
Brasil Ações IBRX Indexado FIC FI	R.V.	8.398.526,10	-0,12	-0,12	-8,75	-8,75			1,83	1,83
TOTAL		587.962.944,99								

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
FI Caixa Brasil IPCA XI Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	17.483.550,00	2,30	2,30	163,26	163,26	391,61	391,61		
FI Caixa Brasil IPCA XII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	17.466.687,50	2,28	2,28	162,32	162,32	389,34	389,34		
FI Caixa Brasil IPCA XIII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	16.989.662,50	2,25	2,25	160,05	160,05	383,91	383,91		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	61.307,58	0,61	0,61	43,30	43,30	103,85	103,85		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	83.592.817,89	0,58	0,58	41,23	41,23	98,89	98,89		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	10.490.201,70	0,17	0,17	12,19	12,19	29,25	29,25		
FIDC da Companhia Estadual de Águas e Esgotos-CEDAE	R.F.	3.264.202,60	-1,02	-1,02	-72,79	-72,79	-174,59	-174,59		
Caixa FI em Ações Valor IBX-50	R.V.	16.351.092,76	-0,36	-0,36	-25,52	-25,52			1,59	1,59
Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS	R.V.	10.649.516,42	2,83	2,83	200,91	200,91			4,78	4,78
FI Caixa Brasil IPCA V Multimercado Crédito Privado	M.M.	16.159.950,00	2,36	2,36	167,93	167,93	402,81	402,81		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	5.932.123,20	2,34	2,34	166,01	166,01	398,20	398,20		
FI Caixa Brasil IPCA VIII Multimercado Crédito Privado	M.M.	5.355.871,88	2,50	2,50	177,44	177,44	425,61	425,61		
TOTAL		203.796.984,03								

BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	179.802.044,34	0,60	0,60	42,53	42,53	102,01	102,01		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	87.365.669,55	0,29	0,29	20,72	20,72	49,71	49,71		
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.	18.180.119,20	-0,21	-0,21	-15,13	-15,13			1,74	1,74
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	2.204.541,53	-0,64	0,00	-45,20	0,00			1,32	1,95
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	1.199.222,77	0,55	0,55	39,37	39,37	94,4	94,43		
TOTAL		288.751.597,39								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	93.920.922,95	0,52	0,52	36,71	36,71	88,04	88,04		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	10.514.829,90	0,16	0,16	11,66	11,66	27,97	27,97		
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	37.765.255,24	0,10	0,10	6,76	6,76			2,05	2,05
FIC FIP Kinea Private Equity II	R.V.	747.902,45	-1,48	-1,48	-105,00	-105,00			0,48	0,48
TOTAL		142.948.910,54								

BANCO HSBC BANK BRASIL S/A										
Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo	R.F.	101.559.963,93	-0,21	-0,21	-14,61	-14,61	-35,05	-35,05		
Hsbc FI em Ações Ibovespa Top	R.V.	22.059.935,98	-2,21	-2,21	-157,00	-157,00			-0,26	-0,26
Hsbc FI Ações Setorial Ativo	R.V.	0,00	2,04	2,04	145,35	145,35			4,00	4,00
Hsbc FI Ações Ibovespa Kazan Plus	R.V.	3.887.124,11	-1,63	-1,63	-115,79	-115,79			0,32	0,32
TOTAL		127.507.024,02								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	68.395.075,02	0,54	0,54	38,50	38,50	92,34	92,34		
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	9.345.560,70	0,56	0,56	40,01	40,01	95,97	95,97		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	1.652.360,59	1,77	1,77	126,16	126,16			3,73	3,73
TOTAL		79.392.996,31								

SCHRODERS INVESTMENT										
Schroder FI em Ações IBRX-50	R.V.	30.075.891,62	-1,01	-1,01	-71,54	-71,54			0,95	0,95
TOTAL		30.075.891,62								

GW CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.										
GW Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	554.443,23	8,59	8,59	610,79	610,79			10,55	10,55
TOTAL		554.443,23								

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.										
BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.489.386,59	-0,74	-0,74	-52,72	-52,72			1,21	1,21
TOTAL		2.489.386,59								

BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A										
FIDC Aberto CPP540 RPPS	R.F.	17.112.993,87	1,28	1,28	90,93	90,93	218,12	218,12		
TOTAL		17.112.993,87								

BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	21.603.989,19	0,46	0,46	32,50	32,50	77,96	77,96		
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	9.806.175,19	-0,14	-0,14	-9,75	-9,75	-23,40	-23,40		
BTG Pactual Dividendos FI de Ações	R.V.	24.586.544,24	2,02	2,02	143,61	143,61			3,97	3,97
TOTAL		55.996.708,62								

GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.										
Geração Futuro Dividendos FIA	R.V.	1.463.481,04	-2,94	-2,94	-209,33	-209,33			-0,99	-0,99
TOTAL		1.463.481,04								

QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.										
Queluz Valor Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.740.444,00	0,34	0,34	24,01	24,01			2,29	2,29
TOTAL		1.740.444,00								

PATRIA INVESTIMENTOS LTDA.										
Patria Special Opportunities I FIQ FI	R.V.	1.565.697,23	-0,83	-0,83	-58,72	-58,72			1,13	1,13
TOTAL		1.565.697,23								

TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO		1.541.359.503,48	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 31/01/2013							
---	--	-------------------------	---	--	--	--	--	--	--	--

PLANO PREVIDENCIÁRIO
CAIXA ECONOMICA FEDERAL

Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	168.719.651,56	-0,88	-0,88	-62,84	-62,84	-150,73	-150,73		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	82.297.461,67	0,58	0,58	41,23	41,23	98,89	98,89		
FI Caixa Brasil IPCA XV Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	5.710.102,92	2,36	2,36	167,45	167,45	401,66	401,66		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	8.527,98	0,61	0,61	43,30	43,30	103,85	103,85		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	5.692.596,35	2,34	2,34	166,01	166,01	398,20	398,20		
TOTAL		262.428.340,48								

BANCO DO BRASIL S/A

BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	23.864.994,26	0,51	0,51	36,21	36,21	86,85	86,85		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	3.701.057,70	0,52	0,52	37,15	37,15	89,12	89,12		
TOTAL		27.566.051,96								

GWI CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.

GWI Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.599.845,89	8,59	8,59	610,79	610,79			10,55	10,55
TOTAL		1.599.845,89								

BANCO BTG PACTUAL

BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	10.694.976,42	-0,14	-0,14	-9,75	-9,75	-23,40	-23,40		
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	3.820.482,92	0,46	0,46	32,50	32,50	77,96	77,96		
TOTAL		14.515.459,34								

BANCO BRADESCO S/A

Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	11.840.466,68	0,60	0,60	42,53	42,53	102,01	102,01		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	1.207.278,93	0,29	0,29	20,72	20,72	49,71	49,71		
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	761.351,27	-0,64	-0,64	-45,20	-45,20			1,32	1,32
TOTAL		13.809.096,88								

ITAU UNIBANCO S/A

Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	1.992.413,09	0,52	0,52	36,71	36,71	88,04	88,04		
TOTAL		1.992.413,09								

BANCO SANTANDER S/A

Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	3.086.446,03	0,54	0,54	38,50	38,50	92,34	92,34		
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	227.230,96	0,56	0,56	40,01	40,01	95,97	95,97		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	763.822,88	1,77	1,77	126,16	126,16			3,73	3,73
TOTAL		4.077.499,87								

TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO
325.988.707,51
DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 31/01/2013
TOTAL GERAL APLICADO - (R\$)
1.867.348.210,99
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO
RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 31/01/2013
PLANO FINANCEIRO

DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	506.087.840,87	32,83%	2.798.111,58
FUNDOS DE RENDA FIXA	801.127.530,85	51,97%	4.501.257,14
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	205.496.963,91	13,33%	-700.323,08
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	28.647.167,85	1,86%	645.380,96
SALDO EM CONTAS CORRENTES	63.330,11	0,00%	
TOTAIS	1.541.422.833,59	100,00%	7.244.426,60

PLANO PREVIDENCIÁRIO

DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	168.719.651,56	51,76%	789.162,12
FUNDOS DE RENDA FIXA	148.451.439,56	45,54%	841.648,09
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	3.125.020,04	0,96%	135.038,70
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	5.692.596,35	1,75%	129.911,71
SALDO EM CONTAS CORRENTES	4.498,82	0,00%	
TOTAIS	325.993.206,33	100,00%	1.895.760,62

CONSOLIDAÇÃO DOS PLANOS NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - JANEIRO DE 2013
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO

DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	674.807.492,43	36,14%	3.587.273,70
FUNDOS DE RENDA FIXA	949.578.970,41	50,85%	5.342.905,23
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	208.621.983,95	11,17%	-565.284,38
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	34.339.764,20	1,84%	775.292,67
SALDO EM CONTAS CORRENTES	67.828,93	0,00%	
TOTAIS	1.867.416.039,92	100,00%	9.140.187,22

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 - JANEIRO DE 2013

INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL S/A	615.528.996,95	61.766,32	615.590.763,27	32,96%	7
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	466.225.324,51	4.264,30	466.229.588,81	24,97%	14
BANCO BRADESCO S/A	302.560.694,27	0,00	302.560.694,27	16,20%	5
ITAU UNIBANCO S/A	144.941.323,63	0,00	144.941.323,63	7,76%	4
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	127.507.024,02	1.798,31	127.508.822,33	6,83%	3
BANCO SANTANDER S/A	83.470.496,18	0,00	83.470.496,18	4,47%	3
SCHROEDERS INVESTIMENT	30.075.891,62	0,00	30.075.891,62	1,61%	1
GWI CONSULT. PARTICIP. E SERV. LTDA.	2.154.289,12	0,00	2.154.289,12	0,12%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.489.386,59	0,00	2.489.386,59	0,13%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A	17.112.993,87	0,00	17.112.993,87	0,92%	3
BANCO BTG PACTUAL	70.512.167,96	0,00	70.512.167,96	3,78%	3
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.	1.463.481,04	0,00	1.463.481,04	0,08%	1
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.	1.740.444,00	0,00	1.740.444,00	0,09%	1
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA	1.565.697,23	0,00	1.565.697,23	0,08%	1
TOTAIS	1.867.348.210,99	67.828,93	1.867.416.039,92	100,00%	48

Em janeiro de 2013, os índices para atingimento das metas, atuarial e gerencial, são os seguintes:

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	INDICE	JAN/13	2013	INDICE	JAN/13	2013
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,41	1,41	C.D.I.	0,59	0,59
RENTA FIXA	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,41	1,41	C.D.I.	0,59	0,59
RENTA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,41	1,41	IBOVESPA	-1,95	-1,95
RENTA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,41	1,41	C.D.I.	0,59	0,59

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 2013, distribuídos em 02 (duas) Carteira de Administradas de Títulos Públicos Federais e 46 (quarenta e seis) Fundos de Investimentos, sendo estes últimos distribuídos em 24 (vinte e quatro) fundos de renda fixa, 18 (dezoito) fundos de renda variável e 04 (quatro) fundos multimercado.