

**RELATORIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV**

**CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - DEZEMBRO DE 2010**

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO	SEGMENTO	VALOR R\$	RENDIMENTO DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
			NO MÊS	NO ANO 2010	META ATUARIAL		META GERENCIAL			
					INPC + 6%a.a.		CDI		IBOVESPA	
					NO MÊS	NO ANO 2010	NO MÊS	NO ANO 2010	NO MÊS	NO ANO 2010

**PLANO FINANCEIRO**

<b>BANCO DO BRASIL S/A</b>										
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)		56.317.502,98	1,73	11,41	159,24	91,50	186,64	117,11		
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)	R.F.	2.841.857,51								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)		257.393.481,52								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-F (PRE)		3.093.481,30								
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	36.680.231,56	2,25	14,44	206,68	115,78	242,25	148,19		
FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F - CAESB	R.F.	20.314.348,78	1,19	1,57	109,50	12,59	128,34	16,11		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	35.199.504,62	2,04	-3,10	187,97	-24,89			-0,32	-4,15
Brasil Ações IBrX Indexado FIC FI	R.V.	9.427.221,51	3,13	-2,14	287,57	-17,18			0,76	-3,19
<b>TOTAL</b>		<b>421.267.629,78</b>								

**CAIXA ECONOMICA FEDERAL**

Caixa FI em Ações Ibovespa Ativo	R.V.	4.203.668,98	1,31	-1,36	120,11	-10,94			-1,06	-2,41
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	17.486.138,72	3,34	-1,01	307,63	-8,06			0,98	-2,05
<b>TOTAL</b>		<b>21.689.807,70</b>								

**BANCO BRADESCO S/A**

Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	85.819.516,52	2,34	16,76	214,88	134,41	251,86	172,03		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	37.242.947,64	1,39	12,56	127,56	100,74	149,52	128,94		
Bradesco FIC FI em Ações Ibovespa Indexado	R.V.	17.550.008,25	1,97	-3,03	181,36	-24,33			-0,39	-4,08
Bradesco FIC FI Multimercado Golden Profit Moderado	M.M.	2.324.760,46	1,01	4,89	93,15	39,22	109,18	50,20		
<b>TOTAL</b>		<b>142.937.232,87</b>								

**ITAU UNIBANCO S/A**

Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	46.510.017,76	2,35	16,24	216,54	130,23	253,80	166,68		
Unibanco Private Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	2.974.094,39	2,05	-2,03	188,61	-16,25			-0,31	-3,07
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	22.724.806,71	1,54	10,94	141,66	87,71			-0,82	9,89
Unibanco Equity Hedge FI Multimercado	M.M.	5.319,90	1,47	11,84	135,21	94,92	158,48	121,49		
<b>TOTAL</b>		<b>72.214.238,76</b>								

**BANCO HSBC BANK BRASIL S/A**

Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo	R.F.	38.251.845,08	1,12	9,72	103,00	77,96	120,73	99,78		
Hsbc FI Ações Top	R.V.	28.835.086,09	2,11	-1,15	193,95	-9,19			-0,25	-2,19
Hsbc FI Ações Setorial Ativo	R.V.	3.351.839,95	3,39	6,68	311,63	53,59			1,02	5,64
<b>TOTAL</b>		<b>70.438.771,12</b>								

**BANCO SANTANDER S/A**

Santander FIC FI Renda Fixa IMA-B Títulos Públicos	R.F.	26.990.970,25	2,27	15,92	208,68	127,70	244,59	163,44		
<b>TOTAL</b>		<b>26.990.970,25</b>								

**BANCO PANAMERICANO S/A**

Master Panamericano FIDC CDC Veículos	R.F.	935.501,69	1,04	10,97	95,60	88,00	112,05	112,63		
<b>TOTAL</b>		<b>935.501,69</b>								

**SCHRODERS INVESTIMENT**

Schroder Previdenciário FI em Ações IBrX-50	R.V.	43.724.282,10	3,72	-0,69	342,40	-5,54			1,36	-1,74
<b>TOTAL</b>		<b>43.724.282,10</b>								

**GWJ CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.**

GWJ Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.680.763,05	4,65	9,81	427,94	78,67			2,29	8,77
<b>TOTAL</b>		<b>1.680.763,05</b>								

**BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.**

BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.616.447,95	2,84	1,71	261,07	13,71			0,47	0,66
<b>TOTAL</b>		<b>2.616.447,95</b>								

**BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A**

FIDC Aberto BCSul Verax CPP360	R.F.	46.208.498,16	1,04	10,79	95,60	86,53	112,05	110,75		
FIDC Fechado BCSul Verax Multicred Financeiro	R.F.	30.076.379,60	1,25	13,70	114,60	109,86	134,32	140,61		
<b>TOTAL</b>		<b>76.284.877,76</b>								

**TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO**

**880.780.523,03**

**DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 31/12/2010**

**PLANO PREVIDENCIÁRIO**

<b>CAIXA ECONOMICA FEDERAL</b>										
Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	142.367.635,93	1,20	12,55	110,42	100,64	129,42	128,81		
Caixa FI Novo Brasil RF Crédito Privado LP	R.F.	9.012.537,03	1,87	14,61	171,97	117,15	201,56	149,93		
<b>TOTAL</b>		<b>151.380.172,96</b>								

**BANCO DO BRASIL S/A**

BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	14.076.503,77	2,25	14,44	206,68	115,78	242,25	148,19		
<b>TOTAL</b>		<b>14.076.503,77</b>								

**TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO**

**165.456.676,73**

**DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 31/12/2010**

**TOTAL GERAL APLICADO - (R\$)**

**1.046.237.199,76**

**PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO**

**RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 31/12/2010**

**PLANO FINANCEIRO**

DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	319.646.323,31	35,73%	5.465.975,64
FUNDOS DE RENDA FIXA	369.030.257,04	41,25%	6.191.206,14
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	189.773.862,32	21,21%	4.774.162,42
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	2.330.080,36	0,26%	23.376,11
SALDO EM CONTAS CORRENTES	13.780.109,54	1,54%	
<b>TOTAIS</b>	<b>894.560.632,57</b>	<b>100,00%</b>	<b>16.454.720,31</b>

**PLANO PREVIDENCIÁRIO**

DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	142.367.635,93	86,04%	1.686.216,05
FUNDOS DE RENDA FIXA	23.089.040,80	13,95%	467.541,40
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	0,00	0,00%	0,00
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	0,00	0,00%	0,00
SALDO EM CONTAS CORRENTES	4.445,71	0,00%	
<b>TOTAIS</b>	<b>165.461.122,44</b>	<b>100,00%</b>	<b>2.153.757,45</b>

**CONSOLIDAÇÃO DOS PLANOS NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - DEZEMBRO DE 2010**  
**PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO**

DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO
			TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	462.013.959,24	43,59%	7.152.191,69
FUNDOS DE RENDA FIXA	392.119.297,84	36,99%	6.658.747,54
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	189.773.862,32	17,90%	4.774.162,42
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	2.330.080,36	0,22%	23.376,11
SALDO EM CONTAS CORRENTES	13.784.555,25	1,30%	
<b>TOTAIS</b>	<b>1.060.021.755,01</b>	<b>100,00%</b>	<b>18.608.477,76</b>

**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 - DEZEMBRO DE 2010**

INSTITUIÇÃO	FUNDO	CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL S/A	435.344.133,55	91.094,72	435.435.228,27	41,08%	5
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	173.069.980,66	1.256,28	173.071.236,94	16,33%	4
BANCO BRADESCO S/A	142.937.232,87	966.186,43	143.903.419,30	13,58%	4
ITAU UNIBANCO S/A	72.214.238,76	747,44	72.214.986,20	6,81%	4
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	70.438.771,12	4.018,93	70.442.790,05	6,65%	3
BANCO SANTANDER S/A	26.990.970,25	721.251,45	27.712.221,70	2,61%	1
BANCO PANAMERICANO S/A	935.501,69	0,00	935.501,69	0,09%	1
SCHRODERS INVESTIMENT	43.724.282,10	0,00	43.724.282,10	4,12%	1
GWI CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.	1.680.763,05	0,00	1.680.763,05	0,16%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.616.447,95	0,00	2.616.447,95	0,25%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A	76.284.877,76	12.000.000,00	88.284.877,76	8,33%	2
<b>TOTAIS</b>	<b>1.046.237.199,76</b>	<b>13.784.555,25</b>	<b>1.060.021.755,01</b>	<b>100,00%</b>	<b>27</b>

Em dezembro de 2010, os índices para atingimento das metas, atuarial e gerencial, são os seguintes:

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	ÍNDICE	DEZ/10	2010	ÍNDICE	DEZ/10	2010
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC (IBGE) + 6%	1,09	12,47	C.D.I.	0,93	9,74
RENDA FIXA	INPC (IBGE) + 6%	1,09	12,47	C.D.I.	0,93	9,74
RENDA VARIÁVEL	INPC (IBGE) + 6%	1,09	12,47	IBOVESPA	2,36	1,04
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC (IBGE) + 6%	1,09	12,47	C.D.I.	0,93	9,74

A Amapá Previdência, seguindo as diretrizes estabelecidas em sua Política de Investimentos e a Resolução nº 3790/2009 do Conselho Monetário Nacional, aplicou seus recursos de maneira diversificada em dezembro de 2010, distribuídos em 02 (duas) Carteira de Administradas de Títulos Públicos Federais e 25 (vinte e cinco) Fundos de Investimentos, sendo estes últimos distribuídos em 11 (onze) fundos de renda fixa, 12 (doze) fundos de renda variável e 02 (dois) fundos multimercado.