

RELATORIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - JULHO DE 2010

ALOCÇÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO	SEGMENTO	VALOR R\$	RENDIMENTO DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
					META ATUARIAL		META GERENCIAL			
					INPC + 6%a.a.		CDI		IBOVESPA (*)	
					0,42	6,77	0,86	5,18	10,80	-1,56
NO MÊS	NO ANO 2010	NO MÊS	NO ANO 2010	NO MÊS	NO ANO 2010	NO MÊS	NO ANO 2010			

BANCO DO BRASIL

Carteira Administrada - Brasil LFT (POS)		41.705.513,19									
Carteira Administrada - Brasil LTN (PRE)	R.F.	2.722.161,61	1,53	5,46	367,12	80,68	178,44	105,50			
Carteira Administrada - Brasil NTN-B (POS)		258.014.577,52									
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	43.603.703,73	1,60	6,65	384,02	98,19	186,66	128,40			
FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F - CAESB	R.F.	20.460.207,50	1,16	2,30	278,52	34,00	135,38	44,46			
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	34.898.595,73	10,53	(3,93)	2.526,45	(58,11)				(0,27)	(2,37)
Brasil Ações IBrX Indexado FIC FI	R.V.	9.175.697,67	10,73	(4,75)	2.575,05	(70,23)				(0,07)	(3,19)
TOTAL		410.580.456,95									

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Carteira Administrada - Caixa NTN-B (POS)	R.F.	139.523.654,54	1,59	7,61	381,28	112,45	185,32	147,05			
Caixa FI Novo Brasil RF Crédito Privado LP	R.F.	4.184.622,09	1,41	7,14	337,32	105,54	163,96	138,02			
Caixa FI em Ações Ibovespa Ativo	R.V.	4.134.504,39	11,03	(2,99)	2.646,69	(44,13)				0,23	(1,42)
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	17.016.412,36	11,68	(3,66)	2.803,11	(54,15)				0,88	(2,10)
TOTAL		164.859.193,38									

BRDESCO

Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	72.428.003,00	1,56	8,21	374,73	121,36	182,14	158,69			
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	31.158.221,02	1,30	6,95	312,26	102,68	151,78	134,27			
Bradesco FIC FI em Ações Ibovespa Indexado	R.V.	17.402.450,77	10,42	(3,85)	2.499,15	(56,88)				(0,38)	(2,28)
Bradesco FIC FI Multimercado Golden Profit Moderado	M.M.	2.265.813,54	2,58	2,23	618,71	32,97	300,73	43,11			
TOTAL		123.254.488,33									

ITAU UNIBANCO

Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	39.981.866,17	1,54	7,92	368,41	116,98	179,07	152,97			
Unibanco Private Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	2.936.618,92	10,50	(3,26)	2.519,15	(48,18)				(0,30)	(1,70)
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	21.025.566,03	10,76	2,64	2.581,52	39,04				(0,04)	4,21
Unibanco Equity Hedge FI Multimercado	M.M.	5.013,15	0,42	5,39	100,02	79,62	48,62	104,12			
TOTAL		63.949.064,27									

HSBC

Hsbc FI Renda Fixa Ativo Regimes Próprios	R.F.	35.885.411,85	1,30	5,01	312,45	74,03	151,87	96,80			
Hsbc FI Ações Top	R.V.	28.377.904,16	10,52	(2,71)	2.524,51	(40,09)				(0,28)	(1,15)
Hsbc FI Ações Setorial Ativo	R.V.	3.214.058,12	11,49	2,30	2.755,84	33,94				0,69	3,86
TOTAL		67.477.374,13									

SANTANDER

Santander FIC FI Renda Fixa IMA-B Títulos Públicos	R.F.	23.581.041,70	1,56	7,81	373,53	115,40	181,56	150,90			
TOTAL		23.581.041,70									

BANCO CRUZEIRO DO SUL

FIDC Aberto BcSul Verax CPP360	R.F.	0,00	0,94	5,71	226,39	84,33	110,04	110,28			
TOTAL		0,00									

BANCO PANAMERICANO

Master Panamericano FIDC CDC Veículos	R.F.	85.259.894,77	0,96	5,81	230,52	85,91	112,05	112,34			
TOTAL		85.259.894,77									

SCHRODERS INVESTMENT

Schroder Previdenciário FI em Ações IBR-50	R.V.	42.271.900,76	11,34	(3,99)	2.721,92	(58,95)				0,55	(2,43)
TOTAL		42.271.900,76									

GWI

GWI Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.526.151,59	6,03	(0,29)	1.447,29	(4,30)				(4,77)	1,27
TOTAL		1.526.151,59									

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.

BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.510.984,80	10,62	(2,39)	2.548,83	(35,32)				(0,18)	(0,83)
TOTAL		2.510.984,80									

TOTAL GERAL DA CARTEIRA

985.270.550,68

DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/07/2010

POSIÇÃO POR SEGMENTO - JULHO DE 2010			RENDIMENTO
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	LÍQUIDO NO MÊS
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	441.965.906,86	44,74%	6.779.381,66
FUNDOS RENDA FIXA	356.542.971,83	36,10%	4.553.668,71
FUNDOS RENDA VARIÁVEL	184.490.845,30	18,68%	17.901.482,95
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	2.270.826,69	0,23%	56.976,21
CONTA CORRENTE	2.493.574,44	0,25%	
T O T A I S	987.764.125,12	100,00%	29.291.509,53

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 - JULHO DE 2010					
INSTITUIÇÃO	FUNDO	CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL	410.580.456,95	2.482.115,75	413.062.572,70	41,82%	5
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	164.859.193,38	2.386,38	164.861.579,76	16,69%	4
BRADESCO	123.254.488,33	4.973,72	123.259.462,05	12,48%	4
ITAU / UNIBANCO	63.949.064,27	28,21	63.949.092,48	6,47%	4
H S B C	67.477.374,13	4.018,93	67.481.393,06	6,83%	3
SANTANDER	23.581.041,70	51,45	23.581.093,15	2,39%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL	0,00		0,00	0,00%	1
BANCO PANAMERICANO	85.259.894,77		85.259.894,77	8,63%	1
SCHRODER INVESTIMENT	42.271.900,76		42.271.900,76	4,28%	1
GWI	1.526.151,59		1.526.151,59	0,15%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.510.984,80	0,00	2.510.984,80	0,25%	1
T O T A I S	985.270.550,68	2.493.574,44	987.764.125,12	100,00%	26

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

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	ÍNDICE	JUL/10	2010	ÍNDICE	JUL/10	2010
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6%	0,42	6,77	C.D.I.	0,86	5,18
RENDA FIXA	INPC(IBGE) + 6%	0,42	6,77	C.D.I.	0,86	5,18
RENDA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6%	0,42	6,77	IBOVESPA	10,80	-1,56
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6%	0,42	6,77	C.D.I.	0,86	5,18

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 julho de 2010, distribuídos em 02 (duas) Carteira de Administradas de Títulos Públicos Federais e 24 (vinte e quatro) Fundos de Investimentos, sendo estes últimos distribuídos em 10 (dez) fundos de renda fixa, 12 (doze) fundos de renda variável e 02 (dois) fundos multimercado.