

**RELATORIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV**
**CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - JUNHO DE 2010**

ALOCÇÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO	SEGMENTO	VALOR R\$	RENDIMENTO DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
					META ATUARIAL		META GERENCIAL			
					INPC + 6%a.a.		CDI		IBOVESPA (*)	
					0,38	6,34	0,79	4,28	-3,35	-11,16
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)		44.623.793,73									
Carteira Administrada - Brasil LTN (PRE)	R.F.	2.690.694,14	1,07	3,86	284,00	60,92	135,76	90,16			
Carteira Administrada - Brasil NTN-B (POS)		250.527.487,42									
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	34.576.989,66	1,17	4,97	311,12	78,36	148,72	115,98			
FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F - CAESB	R.F.	20.225.444,30	1,08	1,13	285,98	17,79	136,71	26,33			
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	31.574.119,92	(3,90)	(13,08)	(1.036,32)	(206,49)			(0,56)	(1,93)	
Brasil Ações IBRX Indexado FIC FI	R.V.	8.286.426,14	(5,21)	(13,98)	(1.382,71)	(220,69)			(1,86)	(2,83)	
<b>TOTAL</b>		<b>392.504.955,31</b>									

**CAIXA ECONÔMICA FEDERAL**

Carteira Administrada - Caixa NTN-B (POS)	R.F.	137.341.221,14	0,99	6,01	261,71	94,85	125,10	140,38			
Caixa FI Novo Brasil RF Crédito Privado LP	R.F.	4.141.451,76	1,16	5,66	309,14	89,28	147,78	132,15			
Caixa FI em Ações Ibovespa Ativo	R.V.	3.723.765,40	(3,71)	(12,62)	(985,46)	(199,24)			(0,37)	(1,47)	
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	15.236.473,83	(5,52)	(13,74)	(1.463,93)	(216,87)			(2,17)	(2,58)	
<b>TOTAL</b>		<b>160.442.912,13</b>									

**BRDESCO**

Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	62.318.357,93	1,29	6,55	342,57	103,35	163,76	152,97			
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	21.331.908,76	0,95	5,57	251,27	87,98	120,11	130,22			
Bradesco FIC FI em Ações Ibovespa Indexado	R.V.	15.760.903,03	(3,66)	(12,92)	(971,69)	(203,89)			(0,31)	(1,76)	
Bradesco FIC FI Multimercado Golden Profit Moderado	M.M.	2.208.858,13	(0,31)	(0,34)	(82,65)	(5,34)	(39,51)	(7,91)			
<b>TOTAL</b>		<b>101.620.027,85</b>									

**ITAU UNIBANCO**

Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	35.349.592,56	1,25	6,28	332,79	99,19	159,08	146,80			
Unibanco Private Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	2.657.605,75	(3,58)	(12,45)	(949,35)	(196,52)			(0,23)	(1,29)	
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	17.747.213,14	(1,54)	(7,33)	(408,32)	(115,65)			1,81	3,83	
Unibanco Equity Hedge FI Multimercado	M.M.	4.992,35	0,51	4,95	135,90	78,14	64,96	115,64			
<b>TOTAL</b>		<b>55.759.403,80</b>									

**HSBC**

Hsbc FI Renda Fixa Ativo Regimes Próprios	R.F.	7.108.768,36	0,85	3,66	224,84	57,76	107,48	85,49			
Hsbc FI Ações Top	R.V.	25.676.472,08	(3,34)	(11,97)	(887,09)	(188,98)			0,01	(0,82)	
Hsbc FI Ações Setorial Ativo	R.V.	2.882.948,85	(3,21)	(8,24)	(851,66)	(130,07)			0,14	2,92	
<b>TOTAL</b>		<b>35.668.189,29</b>									

**SANTANDER**

Santander FIC FI Institucional RF RPPS Títulos Públicos	R.F.	19.897.704,89	1,26	6,16	335,03	97,17	160,15	143,82			
<b>TOTAL</b>		<b>19.897.704,89</b>									

**BANCO CRUZEIRO DO SUL**

FIDC Aberto BcSul Verax CPP360	R.F.	60.091.911,72	0,87	4,72	230,18	74,48	110,03	110,23			
<b>TOTAL</b>		<b>60.091.911,72</b>									

**BANCO PANAMERICANO**

Master Panamericano FIDC CDC Veículos	R.F.	84.448.579,10	0,88	4,81	234,39	75,86	112,04	112,28			
<b>TOTAL</b>		<b>84.448.579,10</b>									

**SCHRODERS INVESTIMENT**

Schroder Previdenciário FI em Ações IBRX-50	R.V.	37.965.228,04	(6,04)	(13,77)	(1.604,36)	(217,34)			(2,70)	(2,61)	
<b>TOTAL</b>		<b>37.965.228,04</b>									

**GWI**

GWI Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.439.335,97	6,16	(5,96)	1.634,38	(94,11)			9,51	5,19	
<b>TOTAL</b>		<b>1.439.335,97</b>									

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

BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.269.870,20	(3,47)	(11,76)	(920,39)	(185,65)			(0,12)	(0,61)	
<b>TOTAL</b>		<b>2.269.870,20</b>									

**TOTAL GERAL DA CARTEIRA**
**952.108.118,30**
**DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/06/2010**

POSIÇÃO POR SEGMENTO - JUNHO DE 2010			RENDIMENTO
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	LÍQUIDO NO MÊS
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	435.183.196,43	45,55%	4.521.890,84
FUNDOS RENDA FIXA	349.490.709,04	36,58%	3.654.863,53
FUNDOS RENDA VARIÁVEL	165.220.362,35	17,29%	-7.169.909,24
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	2.213.850,48	0,23%	-6.873,94
CONTA CORRENTE	3.289.306,43	0,34%	
<b>T O T A I S</b>	<b>955.397.424,73</b>	<b>100,00%</b>	<b>999.971,19</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 - JUNHO DE 2010					
INSTITUIÇÃO	FUNDO	CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
<b>BANCO DO BRASIL</b>	392.504.955,31	3.277.786,75	395.782.742,06	41,43%	5
<b>CAIXA ECONÔMICA FEDERAL</b>	160.442.912,13	2.386,38	160.445.298,51	16,79%	4
<b>BRDESCO</b>	101.620.027,85	5.061,61	101.625.089,46	10,64%	4
<b>ITAU / UNIBANCO</b>	55.759.403,80	28,21	55.759.432,01	5,84%	4
<b>H S B C</b>	35.668.189,29	3.992,03	35.672.181,32	3,73%	3
<b>SANTANDER</b>	19.897.704,89	51,45	19.897.756,34	2,08%	1
<b>BANCO CRUZEIRO DO SUL</b>	60.091.911,72		60.091.911,72	6,29%	1
<b>BANCO PANAMERICANO</b>	84.448.579,10		84.448.579,10	8,84%	1
<b>SCHRODER INVESTIMENT</b>	37.965.228,04		37.965.228,04	3,97%	1
<b>GW</b>	1.439.335,97		1.439.335,97	0,15%	1
<b>BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.</b>	2.269.870,20	0,00	2.269.870,20	0,24%	1
<b>T O T A I S</b>	<b>952.108.118,30</b>	<b>3.289.306,43</b>	<b>955.397.424,73</b>	<b>100,00%</b>	<b>26</b>

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

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	ÍNDICE	JUN/10	2010	ÍNDICE	JUN/10	2010
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6%	0,38	6,34	C.D.I.	0,79	4,28
RENDA FIXA	INPC(IBGE) + 6%	0,38	6,34	C.D.I.	0,79	4,28
RENDA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6%	0,38	6,34	IBOVESPA	-3,35	-11,16
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6%	0,38	6,34	C.D.I.	0,79	4,28

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 junho 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.