

RELATORIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - SETEMBRO DE 2011

| ALOCAÇÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO | SEGMENTO | VALOR R\$ | RENDIMENTO DO FUNDO | | EM RELAÇÃO | | | | | |
|---|----------|-----------|------------------------|-------------|---------------|-------------|----------------|-------------|--------|-------------|
| | | | | | META ATUARIAL | | META GERENCIAL | | | |
| | | | INPC + 6%a.a. | | CDI | | IBOVESPA | | | |
| | | | NO MÊS | NO ANO 2011 | NO MÊS | NO ANO 2011 | NO MÊS | NO ANO 2011 | NO MÊS | NO ANO 2011 |

PLANO FINANCEIRO

| BANCO DO BRASIL S/A | | | | | | | | | | |
|--|------|-----------------------|--------|---------|----------|----------|--------|--------|--------|--------|
| Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS) | | 50.456.004,45 | | | | | | | | |
| Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS) | R.F. | 310.964.713,56 | 0,92 | 12,98 | 98,21 | 143,06 | 97,71 | 149,39 | | |
| Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE) | | 0,00 | | | | | | | | |
| Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-F (PRE) | | 0,00 | | | | | | | | |
| BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário | R.F. | 33.537.356,61 | 0,66 | 10,09 | 70,38 | 111,19 | 70,01 | 116,12 | | |
| BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC | R.F. | 709.565,16 | 0,89 | 4,67 | 94,59 | 51,50 | 94,10 | 53,78 | | |
| FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F - CAESB | R.F. | 19.368.696,37 | 1,16 | 11,13 | 123,83 | 122,60 | 123,19 | 128,03 | | |
| Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI | R.V. | 19.440.364,50 | (7,96) | (27,31) | (850,27) | (300,85) | | | (0,58) | (2,80) |
| Brasil Ações IBRX Indexado FIC FI | R.V. | 7.280.935,96 | (5,18) | (22,77) | (553,25) | (250,84) | | | 2,20 | 1,73 |
| TOTAL | | 441.757.636,61 | | | | | | | | |

| CAIXA ECONOMICA FEDERAL | | | | | | | | | | |
|--|------|----------------------|--------|---------|----------|----------|--------|--------|------|------|
| FI Caixa Brasil IPCA XI Renda Fixa Crédito Privado | R.F. | 13.735.287,50 | 6,12 | 9,88 | 653,46 | 108,88 | 650,09 | 113,70 | | |
| FI Caixa Brasil IPCA XII Renda Fixa Crédito Privado | R.F. | 13.736.687,50 | 6,07 | 9,89 | 648,35 | 109,00 | 645,00 | 113,83 | | |
| FI Caixa Brasil IPCA XIII Renda Fixa Crédito Privado | R.F. | 13.407.812,50 | 5,68 | 7,26 | 606,23 | 80,02 | 603,10 | 83,56 | | |
| FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo | R.F. | 6.286.611,63 | 0,95 | 8,82 | 101,21 | 97,14 | 100,69 | 101,44 | | |
| FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP | R.F. | 15.771.106,35 | 0,54 | 0,00 | 58,17 | 0,00 | 57,87 | 0,00 | | |
| Caixa FI em Ações Brasil IBX-50 | R.V. | 13.798.336,27 | (5,68) | (24,25) | (606,56) | (267,21) | | | 1,70 | 0,25 |
| TOTAL | | 76.735.841,75 | | | | | | | | |

| BANCO BRADESCO S/A | | | | | | | | | | |
|---|------|-----------------------|--------|---------|----------|----------|----------|---------|------|-------|
| Bradesco FI Renda Fixa IMA-B | R.F. | 107.371.295,87 | 0,69 | 10,36 | 73,72 | 114,10 | 73,34 | 119,16 | | |
| Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral | R.F. | 69.470.794,39 | 1,20 | 10,39 | 127,96 | 114,42 | 127,30 | 119,49 | | |
| Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura | R.V. | 13.740.616,40 | (5,54) | (11,42) | (591,27) | (125,83) | | | 1,84 | 13,08 |
| Bradesco FI Multimercado Plus I | M.M. | 2.420.982,66 | 0,99 | 8,99 | 105,52 | 99,06 | 105,0 | 103,45 | | |
| Bradesco FIC FI Multimercado Golden Profit Moderado | M.M. | 378,99 | (1,16) | (1,91) | (123,68) | (21,05) | (123,04) | (21,99) | | |
| TOTAL | | 193.004.068,31 | | | | | | | | |

| ITAU UNIBANCO S/A | | | | | | | | | | |
|---|------|----------------------|--------|---------|----------|----------|--------|--------|------|------|
| Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI | R.F. | 55.906.095,77 | 0,62 | 10,37 | 66,21 | 114,25 | 65,87 | 119,31 | | |
| Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações | R.V. | 27.392.026,63 | (4,60) | (16,69) | (491,47) | (183,88) | | | 2,78 | 7,81 |
| Unibanco Equity Hedge FI Multimercado | M.M. | 5.786,26 | 1,67 | 8,77 | 178,61 | 96,59 | 177,69 | 100,87 | | |
| TOTAL | | 83.303.908,66 | | | | | | | | |

| BANCO HSBC BANK BRASIL S/A | | | | | | | | | | |
|---|------|-----------------------|--------|---------|------------|----------|--------|--------|--------|--------|
| Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo | R.F. | 80.106.324,48 | 0,96 | 10,54 | 102,26 | 116,08 | 101,74 | 121,22 | | |
| Hsbc FI em Ações Ibovespa Top | R.V. | 19.888.337,75 | (7,42) | (25,28) | (792,37) | (278,55) | | | (0,04) | (0,78) |
| Hsbc FI Ações Setorial Ativo | R.V. | 3.406.702,61 | (9,71) | (26,41) | (1.036,61) | (290,97) | | | (2,33) | (1,91) |
| TOTAL | | 103.401.364,84 | | | | | | | | |

| BANCO SANTANDER S/A | | | | | | | | | | |
|--|------|----------------------|------|-------|-------|--------|-------|--------|--|--|
| Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa | R.F. | 40.424.406,74 | 0,45 | 10,24 | 48,13 | 112,86 | 47,88 | 117,86 | | |
| TOTAL | | 40.424.406,74 | | | | | | | | |

| BANCO PANAMERICANO S/A | | | | | | | | | | |
|--|------|----------------------|------|------|--------|--------|--------|--------|--|--|
| Caixa FIDC Master CDC Veículos do Banco Panamericano | R.F. | 14.392.212,94 | 1,06 | 9,78 | 112,64 | 107,79 | 112,06 | 112,57 | | |
| TOTAL | | 14.392.212,94 | | | | | | | | |

| SCHRODERS INVESTIMENT | | | | | | | | | | |
|------------------------------|------|----------------------|--------|---------|----------|----------|--|--|------|--------|
| Schroder FI em Ações IBRX-50 | R.V. | 26.749.868,13 | (6,20) | (24,74) | (661,60) | (272,62) | | | 1,18 | (0,24) |
| TOTAL | | 26.749.868,13 | | | | | | | | |

| GWJ CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA. | | | | | | | | | | |
|---|------|---------------------|---------|---------|------------|----------|--|--|--------|--------|
| GWJ Classic Fundo de Investimento em Ações | R.V. | 1.574.254,05 | (10,43) | (28,98) | (1.113,72) | (319,24) | | | (3,05) | (4,47) |
| TOTAL | | 1.574.254,05 | | | | | | | | |

| BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. | | | | | | | | | | |
|--|------|---------------------|--------|---------|----------|----------|--|--|------|------|
| BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações | R.V. | 2.012.376,72 | (6,58) | (23,09) | (702,53) | (254,37) | | | 0,80 | 1,41 |
| TOTAL | | 2.012.376,72 | | | | | | | | |

| BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A | | | | | | | | | | |
|---|------|----------------------|------|-------|--------|--------|--------|--------|--|--|
| FIDC Aberto BCSul Verax CPP360 | R.F. | 50.729.207,03 | 1,06 | 9,78 | 112,64 | 107,79 | 112,06 | 112,57 | | |
| FIDC Fechado BCSul Verax Multicred Financeiro | R.F. | 33.310.111,85 | 1,15 | 10,75 | 122,58 | 118,46 | 121,94 | 123,71 | | |
| TOTAL | | 84.039.318,88 | | | | | | | | |

| BANCO BTG PACTUAL | | | | | | | | | | |
|--|------|----------------------|--------|------|----------|-------|--|--|------|-------|
| BTG Pactual Institucional Dividendos FI em Ações | R.V. | 12.829.949,45 | (1,00) | 1,08 | (107,27) | 11,94 | | | 6,38 | 25,58 |
| TOTAL | | 12.829.949,45 | | | | | | | | |

| | | | | | | | | | | |
|---|--|-------------------------|--|--|--|--|--|--|--|---|
| TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO | | 1.080.225.207,08 | | | | | | | | DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/09/2011 |
|---|--|-------------------------|--|--|--|--|--|--|--|---|

PLANO PREVIDENCIÁRIO

| CAIXA ECONOMICA FEDERAL | | | | | | | | | | |
|---|------|-----------------------|------|-------|--------|--------|--------|--------|--|--|
| Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS) | R.F. | 150.035.599,72 | 1,53 | 10,08 | 163,13 | 111,01 | 162,29 | 115,93 | | |
| FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP | R.F. | 35.997.028,32 | 0,54 | 11,29 | 58,17 | 124,43 | 57,87 | 129,94 | | |
| FI Caixa Brasil IPCA XV Renda Fixa Crédito Privado | R.F. | 4.489.136,88 | 4,00 | 0,00 | 426,67 | 0,00 | 424,47 | 0,00 | | |
| FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP | R.F. | 0,00 | 1,65 | 12,63 | 176,39 | 139,18 | 175,48 | 145,34 | | |
| TOTAL | | 190.521.764,92 | | | | | | | | |

| BANCO DO BRASIL S/A | | | | | | | | | | |
|--|------|----------------------|------|-------|-------|--------|-------|--------|--|--|
| BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário | R.F. | 17.310.285,36 | 0,66 | 10,09 | 70,38 | 111,19 | 70,01 | 116,12 | | |
| BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC | R.F. | 0,00 | 0,89 | 4,67 | 94,59 | 51,50 | 94,10 | 53,78 | | |
| TOTAL | | 17.310.285,36 | | | | | | | | |



| GWI CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA. | | | | | | | | | | |
|---|------|---------------------|---------|---------|------------|----------|--|--|--------|--------|
| GWI Classic Fundo de Investimento em Ações | R.V. | 1.097.924,34 | (10,43) | (28,98) | (1.113,72) | (319,24) | | | (3,05) | (4,47) |
| TOTAL | | 1.097.924,34 | | | | | | | | |

| BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A | | | | | | | | | | |
|---------------------------|------|---------------------|------|-------|--------|--------|--------|--------|--|--|
| FIDC Aberto CPP540 RPPS | R.F. | 3.686.014,80 | 1,20 | 10,71 | 128,16 | 118,01 | 127,49 | 123,24 | | |
| TOTAL | | 3.686.014,80 | | | | | | | | |

TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO 212.615.989,42 DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/09/2011

TOTAL GERAL APLICADO - (R\$) 1.292.841.196,50 PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 30/09/2011

| PLANO FINANCEIRO | | | |
|--|-------------------------|----------------|-------------------|
| DESCRIÇÃO | VALOR (R\$) | PARTICIP. (%) | RENDIMENTO (R\$) |
| CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS | 361.420.718,01 | 33,40% | 3.324.168,21 |
| FUNDOS DE RENDA FIXA | 568.263.572,69 | 52,52% | 6.708.271,52 |
| FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL | 148.113.768,47 | 13,69% | (9.218.054,11) |
| FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO | 2.427.147,91 | 0,22% | 23.786,92 |
| SALDO EM CONTAS CORRENTES | 1.750.719,81 | 0,16% | |
| TOTAIS | 1.081.975.926,89 | 100,00% | 838.172,54 |

| PLANO PREVIDENCIÁRIO | | | |
|--|-----------------------|----------------|---------------------|
| DESCRIÇÃO | VALOR (R\$) | PARTICIP. (%) | RENDIMENTO (R\$) |
| CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS | 150.035.599,72 | 70,42% | 2.258.292,39 |
| FUNDOS DE RENDA FIXA | 61.482.465,36 | 28,86% | 510.367,59 |
| FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL | 1.097.924,34 | 0,52% | (127.886,13) |
| FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO | 0,00 | 0,00% | 0,00 |
| SALDO EM CONTAS CORRENTES | 434.718,03 | 0,20% | |
| TOTAIS | 213.050.707,45 | 100,00% | 2.640.773,85 |

**CONSOLIDAÇÃO DOS PLANOS NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - SETEMBRO DE 2011
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO**

| DESCRIÇÃO | VALOR R\$ | % | RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$) |
|---------------------------------------|-------------------------|----------------|----------------------------------|
| CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS | 511.456.317,73 | 39,49% | 5.582.460,60 |
| FUNDOS DE RENDA FIXA | 629.746.038,05 | 48,63% | 7.218.639,11 |
| FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL | 149.211.692,81 | 11,52% | (9.345.940,24) |
| FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO | 2.427.147,91 | 0,19% | 23.786,92 |
| SALDO EM CONTAS CORRENTES | 2.185.437,84 | 0,17% | |
| TOTAIS | 1.295.026.634,34 | 100,00% | 3.478.946,39 |

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 2011

| INSTITUIÇÃO | EM FUNDO | EM CONTA CORRENTE | TOTAL BANCO | % POR INSTITUIÇÃO | QTDE. FUNDOS |
|--------------------------------------|-------------------------|---------------------|-------------------------|-------------------|--------------|
| BANCO DO BRASIL S/A | 459.067.921,97 | 1.936.806,13 | 461.004.728,10 | 35,60% | 6 |
| CAIXA ECONOMICA FEDERAL | 267.257.606,67 | 1.549,88 | 267.259.156,55 | 20,64% | 8 |
| BANCO BRADESCO S/A | 193.004.068,31 | 4.973,72 | 193.009.042,03 | 14,90% | 5 |
| ITAU UNIBANCO S/A | 83.303.908,66 | 739,94 | 83.304.648,60 | 6,43% | 3 |
| BANCO HSBC BANK BRASIL S/A | 103.401.364,84 | 3.918,66 | 103.405.283,50 | 7,98% | 3 |
| BANCO SANTANDER S/A | 40.424.406,74 | 0,00 | 40.424.406,74 | 3,12% | 1 |
| BANCO PANAMERICANO S/A | 14.392.212,94 | 0,00 | 14.392.212,94 | 1,11% | 1 |
| SCHRODERS INVESTIMENT | 26.749.868,13 | 0,00 | 26.749.868,13 | 2,07% | 1 |
| GWI CONSULT. PARTICIP. E SERV. LTDA. | 2.672.178,39 | 0,00 | 2.672.178,39 | 0,21% | 1 |
| BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. | 2.012.376,72 | 0,00 | 2.012.376,72 | 0,16% | 1 |
| BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A | 87.725.333,68 | 0,00 | 87.725.333,68 | 6,77% | 3 |
| BANCO BTG PACTUAL | 12.829.949,45 | 237.449,51 | 13.067.398,96 | 1,01% | 1 |
| TOTAIS | 1.292.841.196,50 | 2.185.437,84 | 1.295.026.634,34 | 100,00% | 34 |

Em setembro de 2011, os índices para atingimento das metas, atuarial e gerencial, são os seguintes:

| SEGMENTO | META ATUARIAL (%) | | | META GERENCIAL (%) | | |
|-------------------------------|----------------------|--------|------|--------------------|--------|--------|
| | INDICE | SET/11 | 2011 | INDICE | SET/11 | 2011 |
| TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS | INPC(IGBE) + 6% a.a. | 0,94 | 9,08 | C.D.I. | 0,94 | 8,69 |
| RENDA FIXA | INPC(IGBE) + 6% a.a. | 0,94 | 9,08 | C.D.I. | 0,94 | 8,69 |
| RENDA VARIÁVEL | INPC(IGBE) + 6% a.a. | 0,94 | 9,08 | IBOVESPA | -7,38 | -24,50 |
| RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO | INPC(IGBE) + 6% a.a. | 0,94 | 9,08 | C.D.I. | 0,94 | 8,69 |

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 2011, distribuídos em 02 (duas) Carteira de Administradas de Títulos Públicos Federais e 32 (trinta e dois) Fundos de Investimentos, sendo estes últimos distribuídos em 18 (dezoito) fundos de renda fixa, 11 (onze) fundos de renda variável e 03 (três) fundos multimercado.