

RELATORIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - AGOSTO DE 2009

ALOCÇÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO	S E G M E N T O	VALOR R\$	RENDIMENTO DO FUNDO		EM RELAÇÃO							
					META ATUARIAL		META GERENCIAL					
							INPC + 6%a.a.		CDI		IBOVESPA	
									0,57	7,13	0,69	6,91
			NO MÊS	NO ANO 2009	NO MÊS	NO ANO 2009	NO MÊS	NO ANO 2009	NO MÊS	NO ANO 2009		

BANCO DO BRASIL

Brasil LFT (POS)	R.F.	301.448.230,53								
Brasil LTN (PRE)	R.F.	5.426.105,98	0,68	6,84	119,99	95,93	98,35	99,00		
Brasil Regime Próprio Arrojado FI Referenciado DI	R.F.	53.646.116,46	0,68	6,94	120,04	97,39	98,39	100,50		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	19.094.210,78	2,17	43,08	382,58	604,27			68,83	83,47
Brasil Ações IBrX Indexado FIC FI	R.V.	8.004.635,14	1,00	36,79	176,41	515,96			31,74	71,27
TOTAL		387.619.298,89								

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Caixa NTN-B (POS)	R.F.	120.169.552,37	0,67	14,27	118,56	200,14	97,18	206,55		
Caixa FI Brasil Títulos Públicos RF	R.F.	9.319.183,21	0,69	7,18	121,81	100,72	99,84	103,94		
Caixa FI em Ações Ibovespa Ativo	R.V.	2.607.782,91	2,97	44,62	524,12	625,81			94,29	86,44
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	206.142,22	1,83	40,06	323,21	561,84			58,15	77,60
TOTAL		132.302.660,71								

BRDESCO

Bradesco FI RF Maxi Poder Público	R.F.	52.411.802,68	0,69	6,99	122,11	98,04	100,09	101,17		
Bradesco FI Referenciado DI Premium	R.F.	16.969.953,30	0,73	7,32	129,66	102,62	106,28	105,90		
Bradesco FIC FI em Ações Ibovespa Indexado	R.V.	6.614.767,55	2,82	46,31	497,09	649,50			89,43	89,71
Bradesco FIC FI Multimercado Golden Profit Moderado	M.M.	2.105.259,67	0,78	10,25	137,61	143,69	112,79	148,29		
TOTAL		78.101.783,20								

ITAU / UNIBANCO

Unibanco Institucional DI FI Referenciado	R.F.	29.394.314,54	0,70	7,07	123,39	99,21	101,13	102,39		
Unibanco Private Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	13.734.134,28	2,86	47,41	504,49	664,93			90,76	91,84
Unibanco Equity Hedge FI Multimercado	M.M.	9.558.640,47	0,15	4,75	26,01	66,65	21,32	68,78		
TOTAL		52.687.089,29								

H S B C

Hsbc FI Referenciado DI Crédito Privado LP Executivo	R.F.	21.154.489,05	0,73	7,23	129,68	101,43	106,29	104,68		
Hsbc FI Referenciado DI Previdenciário Regimes Próprios	R.F.	2.121,85	0,67	6,80	118,23	95,37	96,90	98,42		
Hsbc FI Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	20.964.444,25	0,70	7,12	123,92	99,79	101,57	102,99		
Hsbc FI Ações Top	R.V.	9.580.722,38	2,87	46,95	506,77	658,42			91,17	90,94
TOTAL		51.701.777,53								

SANTANDER

Santander FI Institucional RF	R.F.	17.179.569,09	0,65	7,24	115,43	101,52	94,62	104,76		
TOTAL		17.179.569,09								

BANCO CRUZEIRO DO SUL

FIDC Aberto BcSul Verax CPP360	R.F.	55.670.194,49	0,76	7,63	134,25	106,95	110,04	110,37		
TOTAL		55.670.194,49								

BANCO PANAMERICANO

Master Panamericano FIDC CDC Veículos	R.F.	63.175.350,36	0,77	7,77	136,70	108,97	112,05	112,45		
TOTAL		63.175.350,36								

SCHRODER INVESTMENT

Schroder Previdenciário FI em Ações IBrX-50	R.V.	18.906.273,57	1,46	41,25	257,28	578,57			46,29	79,91
Schroder Brasil Long Short FI Multimercado	M.M.	11.679.693,21	1,28	7,90	226,57	110,75	185,70	114,29		
TOTAL		30.585.966,78								

TOTAL GERAL DA CARTEIRA **869.023.690,34** **DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 31/08/2009**

POSIÇÃO POR SEGMENTO - AGOSTO DE 2009			RENDIMENTO NO MÊS
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	427.043.888,88	49,13%	2.953.368,93
FUNDOS RENDA FIXA	339.887.539,28	39,11%	2.408.650,28
FUNDOS RENDA VARIÁVEL	78.748.668,83	9,06%	1.665.484,62
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	23.343.593,35	2,69%	178.420,86
CONTA CORRENTE	137.248,82	0,02%	
TOTAIS	869.160.939,16	100,00%	7.205.924,69

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 - AGOSTO DE 2009					
INSTITUIÇÃO	FUNDO	CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL	387.619.298,89	120.749,90	387.740.048,79	44,61%	4
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	132.302.660,71	1.445,81	132.304.106,52	15,22%	4
BRDESCO	78.101.783,20	10.973,72	78.112.756,92	8,99%	4
ITAU / UNIBANCO	52.687.089,29	29,00	52.687.118,29	6,06%	3
H S B C	51.701.777,53	3.998,94	51.705.776,47	5,95%	4
SANTANDER	17.179.569,09	51,45	17.179.620,54	1,98%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL	55.670.194,49		55.670.194,49	6,41%	1
BANCO PANAMERICANO	63.175.350,36		63.175.350,36	7,27%	1
SCHRODER INVESTIMENT	30.585.966,78		30.585.966,78	3,52%	2
T O T A I S	869.023.690,34	137.248,82	869.160.939,16	100,00%	24

A Amapá Previdência, seguindo as diretrizes estabelecidas em sua Política de Investimentos, aplicou seus recursos de acordo com a Resolução nº 3506/2007 do Conselho Monetário Nacional, diversificando os recursos em 02 (duas) Carteira de Títulos Públicos Federais e 22 (vinte e dois) Fundos de Investimentos, sendo estes últimos distribuídos em 11 (onze) de renda fixa, 08 (oito) de renda variável e 03 de multimercado.

Os índices para atingimento da metas, atuarial e gerencial, são os seguintes:

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	ÍNDICE	AGO/09	2009	ÍNDICE	AGO/09	2009
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6%	0,57	7,13	C.D.I.	0,69	6,91
RENTA FIXA	INPC(IBGE) + 6%	0,57	7,13	C.D.I.	0,69	6,91
RENTA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6%	0,57	7,13	IBOVESPA	3,15	51,62
RENTA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6%	0,57	7,13	C.D.I.	0,69	6,91