

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

**CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - JULHO DE 2009**

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO	SEGMENTO	VALOR R\$	RENTABILIDADE DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
					META ATUARIAL		META GERENCIAL			
					INPC + 6%a.a.		CDI		IBOVESPA	
					0,72	6,49	0,79	6,17	6,41	45,85
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.	299.372.351,45	0,78	6,12	108,33	94,30	99,33	99,19		
Brasil LTN (PRE)		5.382.536,46								
Brasil Regime Próprio Arrojado FI Referenciado DI	R.F.	54.234.930,46	0,81	6,22	112,50	95,84	103,15	100,81		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	18.689.012,93	5,93	40,05	823,61	617,10			92,51	87,35
Brasil Ações IBX Indexado FIC FI	R.V.	7.925.404,42	4,67	35,43	648,61	545,92			72,85	77,27
<b>TOTAL</b>		<b>385.604.235,72</b>								

**CAIXA ECONÔMICA FEDERAL**

Caixa NTN-B (POS)	R.F.	122.913.492,43	1,43	13,60	198,61	209,55	182,10	220,42		
Caixa FI Brasil Títulos Públicos RF	R.F.	5.713.266,56	0,82	6,45	113,89	99,38	104,42	104,54		
Caixa FI em Ações Ibovespa Ativo	R.V.	2.532.561,49	5,86	40,45	813,89	623,27			91,42	88,22
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	202.434,31	4,75	37,54	659,72	578,43			74,10	81,88
<b>TOTAL</b>		<b>131.361.754,79</b>								

**BRADESCO**

Bradesco FI RF Maxi Poder Público	R.F.	52.051.611,63	0,80	6,25	111,11	96,30	101,87	101,30		
Bradesco FI Referenciado DI Premium	R.F.	15.740.973,94	0,83	6,53	115,28	100,62	105,69	105,83		
Bradesco FIC FI em Ações Ibovespa Indexado	R.V.	6.433.534,03	6,02	42,30	836,11	651,77			93,92	92,26
Bradesco FIC FI Multimercado Golden Profit Moderado	M.M.	2.088.968,76	1,40	9,39	194,44	144,68	178,28	152,19		
<b>TOTAL</b>		<b>76.315.088,36</b>								

**ITAU / UNIBANCO**

Unibanco Institucional DI FI Referenciado	R.F.	29.190.219,95	0,84	6,33	116,67	97,53	106,97	102,59		
Unibanco Private Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	13.352.397,16	6,11	43,31	848,61	667,33			95,32	94,46
Unibanco Equity Hedge FI Multimercado	M.M.	9.544.571,55	(0,46)	4,60	(63,89)	70,88	(58,58)	74,55		
<b>TOTAL</b>		<b>52.087.188,66</b>								

**H S B C**

Hsbc FI Referenciado DI Crédito Privado LP Executivo	R.F.	20.595.141,31	0,87	6,45	120,83	99,38	110,79	104,54		
Hsbc FI Referenciado DI Previdenciário Regimes Próprios	R.F.	2.107,69	0,77	6,08	106,94	93,68	98,05	98,54		
Hsbc FI Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	20.329.899,98	0,80	6,37	111,11	98,15	101,87	103,24		
Hsbc FI Ações Top	R.V.	9.313.260,52	6,13	42,84	851,39	660,09			95,63	93,44
<b>TOTAL</b>		<b>50.240.409,50</b>								

**SANTANDER**

Santander FI Institucional RF	R.F.	15.617.910,52	0,85	6,54	118,06	100,77	108,24	106,00		
<b>TOTAL</b>		<b>15.617.910,52</b>								

**BANCO CRUZEIRO DO SUL**

FIDC Aberto BcSul Verax CPP360	R.F.	55.249.844,64	0,86	6,81	120,03	104,97	110,05	110,42		
<b>TOTAL</b>		<b>55.249.844,64</b>								

**BANCO PANAMERICANO**

Master Panamericano FIDC CDC Veículos	R.F.	62.689.692,13	0,88	6,94	122,22	106,93	112,06	112,48		
<b>TOTAL</b>		<b>62.689.692,13</b>								

**SCHRODER INVESTIMENT**

Schroder Previdenciário FI em Ações IBX-50	R.V.	18.634.579,33	4,08	39,22	566,67	604,31			63,65	85,54
Schroder Brasil Long Short FI Multimercado	M.M.	11.531.632,18	1,20	6,53	166,67	100,62	152,81	105,83		
<b>TOTAL</b>		<b>30.166.211,51</b>								

**TOTAL GERAL DA CARTEIRA**

**859.332.335,83**

**DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 31/07/2009**

POSIÇÃO POR SEGMENTO - JULHO DE 2009			RENTABILIDADE
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	NO MÊS
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	427.668.380,34	49,76%	4.278.102,78
FUNDOS RENDA FIXA	331.415.598,81	38,56%	2.596.104,50
FUNDOS RENDA VARIÁVEL	77.083.184,19	8,97%	3.826.933,82
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	23.165.172,49	2,70%	121.935,68
CONTA CORRENTE	89.194,81	0,01%	
<b>T O T A I S</b>	<b>859.421.530,64</b>	<b>100,00%</b>	<b>10.823.076,78</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 - JULHO DE 2009**

INSTITUIÇÃO	FUNDO	CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
<b>BANCO DO BRASIL</b>	385.604.235,72	72.718,00	385.676.953,72	44,88%	4
<b>CAIXA ECONÔMICA FEDERAL</b>	131.361.754,79	1.445,81	131.363.200,60	15,29%	4
<b>BRADESCO</b>	76.315.088,36	10.973,72	76.326.062,08	8,88%	4
<b>ITAU / UNIBANCO</b>	52.087.188,66	29,00	52.087.217,66	6,06%	3
<b>H S B C</b>	50.240.409,50	3.976,83	50.244.386,33	5,85%	4
<b>SANTANDER</b>	15.617.910,52	51,45	15.617.961,97	1,82%	1
<b>BANCO CRUZEIRO DO SUL</b>	55.249.844,64		55.249.844,64	6,43%	1
<b>BANCO PANAMERICANO</b>	62.689.692,13		62.689.692,13	7,29%	1
<b>SCHRODER INVESTIMENT</b>	30.166.211,51		30.166.211,51	3,51%	2
<b>T O T A I S</b>	<b>859.332.335,83</b>	<b>89.194,81</b>	<b>859.421.530,64</b>	<b>100,00%</b>	<b>24</b>

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	JUL/09	2009	ÍNDICE	JUL/09	2009
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6%	0,72	6,49	C.D.I.	0,79	6,17
RENDA FIXA	INPC(IBGE) + 6%	0,72	6,49	C.D.I.	0,79	6,17
RENDA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6%	0,72	6,49	IBOVESPA	6,41	45,85
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6%	0,72	6,49	C.D.I.	0,79	6,17