

RELATORIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - NOVEMBRO DE 2009

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO	SEGMENTO	VALOR R\$	RENDIMENTO DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
					META ATUARIAL		META GERENCIAL			
					INPC + 6%a.a.		CDI		IBOVESPA (*)	
					0,86	9,54	0,66	9,11	8,93	78,55
NO MÊS	NO ANO 2009	NO MÊS	NO ANO 2009	NO MÊS	NO ANO 2009	NO MÊS	NO ANO 2009			

BANCO DO BRASIL										
Carteira Administrada - Brasil LFT (POS)	R.F.	279.023.515,89	0,65	8,99	75,87	94,21	98,64	98,72		
Carteira Administrada - Brasil LTN (PRE)	R.F.	5.532.702,71								
Brasil Regime Próprio Arrojado FI Referenciado DI	R.F.	31.047.995,28	0,63	9,11	73,76	95,49	95,90	100,07		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	30.404.579,72	8,88	69,08	1.036,81	723,93			(0,05)	(9,46)
Brasil Ações IBrX Indexado FIC FI	R.V.	9.539.554,20	8,50	63,02	992,45	660,36			(0,43)	(15,53)
TOTAL		355.548.347,80								

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL										
Carteira Administrada - Caixa NTN-B (POS)	R.F.	131.775.052,18	0,62	16,22	72,83	169,97	94,69	178,12		
Caixa FI Brasil Títulos Públicos RF	R.F.	188.680,07	0,67	9,36	78,03	98,03	101,45	102,73		
Caixa FI em Ações Ibovespa Ativo	R.V.	3.921.370,97	8,70	70,77	1.015,08	741,57			(0,24)	(7,78)
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	16.493.303,10	8,60	66,38	1.004,36	695,57			(0,33)	(12,17)
TOTAL		152.378.406,32								

BRADERCO										
Braderco FI RF Maxi Poder Público	R.F.	53.453.373,61	0,65	9,12	76,23	95,53	99,11	100,11		
Braderco FI Referenciado DI Premium	R.F.	17.921.581,49	0,70	9,68	81,17	101,43	105,54	106,29		
Braderco FIC FI em Ações Ibovespa Indexado	R.V.	16.290.843,85	8,60	71,91	1.003,73	753,56			(0,34)	(6,63)
Braderco FIC FI Multimercado Golden Profit Moderado	M.M.	2.198.972,38	2,03	15,15	236,45	158,78	307,42	166,40		
TOTAL		89.864.771,33								

ITAU / UNIBANCO										
Unibanco Institucional DI FI Referenciado	R.F.	30.288.493,59	0,69	9,37	81,10	98,17	105,43	102,87		
Unibanco Private Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	16.177.766,71	8,70	73,64	1.015,32	771,64			(0,24)	(4,91)
Unibanco Equity Hedge FI Multimercado	M.M.	9.733.018,69	0,83	6,66	97,12	69,82	126,27	73,17		
TOTAL		56.199.278,99								

HSBC										
Hsbc FI Referenciado DI Crédito Privado LP Executivo	R.F.	22.032.635,83	0,68	9,75	79,21	102,18	102,99	107,08		
Hsbc FI Referenciado DI Previdenciário Regimes Próprios	R.F.	2.165,66	0,64	9,00	74,70	94,31	97,12	98,83		
Hsbc FI Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	21.433.461,34	0,67	9,51	78,33	99,67	101,84	104,45		
Hsbc FI Referenciado DI Longo Prazo Títulos Públicos	R.F.	722.928,60	0,64	8,89	74,81	93,11	97,26	97,57		
Hsbc FI Ações Top	R.V.	26.665.907,56	8,75	73,27	1.021,59	767,84			(0,18)	(5,27)
TOTAL		70.857.098,99								

SANTANDER										
Santander FIC FI Institucional RF	R.F.	17.512.474,60	0,63	9,32	73,75	97,62	95,88	102,30		
TOTAL		17.512.474,60								

BANCO CRUZEIRO DO SUL										
FIDC Aberto BcSul Verax CPP360	R.F.	56.930.299,29	0,73	10,06	84,64	105,43	110,04	110,49		
TOTAL		56.930.299,29								

BANCO PANAMERICANO										
Master Panamericano FIDC CDC Veículos	R.F.	64.631.628,14	0,74	10,25	86,18	107,44	112,05	112,60		
TOTAL		64.631.628,14								

SCHRODERS INVESTIMENT										
Schroder Previdenciário FI em Ações IBrX-50	R.V.	31.274.720,15	8,80	69,47	1.026,97	727,99			(0,14)	(9,07)
Schroder Brasil Long Short FI Multimercado	M.M.	11.979.768,71	0,41	10,67	47,51	111,79	61,77	117,15		
TOTAL		43.254.488,86								

TOTAL GERAL DA CARTEIRA 907.176.794,32 DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/11/2009

POSIÇÃO POR SEGMENTO - NOVEMBRO DE 2009				RENDIMENTO
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%		NO MÊS
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	416.331.270,78	45,63%		2.689.496,62
FUNDOS RENDA FIXA	316.165.717,50	34,65%		2.195.483,16
FUNDOS RENDA VARIÁVEL	150.768.046,26	16,52%		10.300.648,83
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	23.911.759,78	2,62%		172.550,79
CONTA CORRENTE	5.270.581,82	0,58%		
TOTAIS	912.447.376,14	100,00%		15.358.179,40

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 - NOVEMBRO DE 2009						
INSTITUIÇÃO	FUNDO	CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS	
BANCO DO BRASIL	355.548.347,80	5.264.286,08	360.812.633,88	39,54%	4	
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	152.378.406,32	1.256,28	152.379.662,60	16,70%	4	
BRDESCO	89.864.771,33	911,87	89.865.683,20	9,85%	4	
ITAU / UNIBANCO	56.199.278,99	57,21	56.199.336,20	6,16%	3	
H S B C	70.857.098,99	4.018,93	70.861.117,92	7,77%	5	
SANTANDER	17.512.474,60	51,45	17.512.526,05	1,92%	1	
BANCO CRUZEIRO DO SUL	56.930.299,29		56.930.299,29	6,24%	1	
BANCO PANAMERICANO	64.631.628,14		64.631.628,14	7,08%	1	
SCHRODER INVESTIMENT	43.254.488,86		43.254.488,86	4,74%	2	
T O T A I S	907.176.794,32	5.270.581,82	912.447.376,14	100,00%	25	

A Amapá Previdência, seguindo as diretrizes estabelecidas em sua Política de Investimentos e a nova Resolução nº 3790/2009 do Conselho Monetário Nacional, aplica seus recursos de maneira diversificada, distribuídos em 02 (duas) Carteira de Administradas de Títulos Públicos Federais e 23 (vinte e três) Fundos de Investimentos, sendo estes últimos distribuídos em 12 (doze) fundos de renda fixa, 08 (oito) fundos de renda variável e 03 (três) fundos multimercado.

Em novembro de 2009, os índices para atingimento das metas, atuarial e gerencial, são os seguintes:

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	ÍNDICE	NOV/09	2009	ÍNDICE	NOV/09	2009
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6%	0,86	9,54	C.D.I.	0,66	9,11
RENDA FIXA	INPC(IBGE) + 6%	0,86	9,54	C.D.I.	0,66	9,11
RENDA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6%	0,86	9,54	IBOVESPA	8,93	78,55
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6%	0,86	9,54	C.D.I.	0,66	9,11