

RELATORIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - OUTUBRO DE 2009

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO	SEGMENTO	VALOR R\$	RENDIMENTO DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
					META ATUARIAL		META GERENCIAL			
					INPC + 6%a.a.		CDI		IBOVESPA (*)	
					0,73	8,61	0,69	8,39	0,04	63,90
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.	277.192.731,73	0,68	8,29	93,57	96,26	98,42	98,78		
Carteira Administrada - Brasil LTN (PRE)	R.F.	5.491.648,21								
Brasil Regime Próprio Arrojado FI Referenciado DI	R.F.	51.902.961,42	0,69	8,43	95,23	97,86	100,18	100,43		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	27.924.108,44	(0,18)	55,29	(25,16)	641,97			(0,23)	(8,61)
Brasil Ações IBrX Indexado FIC FI	R.V.	8.791.986,65	0,04	50,24	5,02	583,37			(0,01)	(13,66)
TOTAL		371.303.436,45								

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL										
Carteira Administrada - Caixa NTN-B (POS)	R.F.	130.957.394,22	0,56	15,60	77,19	181,13	81,20	185,89		
Caixa FI Brasil Títulos Públicos RF	R.F.	200.655,85	0,68	8,63	93,40	100,19	98,25	102,83		
Caixa FI em Ações Ibovespa Ativo	R.V.	2.832.913,95	(0,07)	57,11	(9,69)	663,05			(0,12)	(6,80)
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	7.328.597,45	(0,07)	53,20	(9,23)	617,66			(0,11)	(10,71)
TOTAL		141.319.561,47								

BRASESCO										
Bradesco FI RF Maxi Poder Público	R.F.	53.106.517,62	0,67	8,41	92,62	97,63	97,43	100,19		
Bradesco FI Referenciado DI Premium	R.F.	17.797.806,00	0,76	8,92	104,31	103,59	109,73	106,32		
Bradesco FIC FI em Ações Ibovespa Indexado	R.V.	14.519.255,49	(0,32)	58,30	(43,87)	676,91			(0,36)	(5,60)
Bradesco FIC FI Multimercado Golden Profit Moderado	M.M.	2.155.309,51	0,38	12,87	51,88	149,39	54,58	153,31		
TOTAL		87.578.888,62								

ITAU / UNIBANCO										
Unibanco Institucional DI FI Referenciado	R.F.	30.079.505,07	0,73	8,61	100,08	100,01	105,27	102,64		
Unibanco Private Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	14.883.108,20	(0,23)	59,74	(31,78)	693,66			(0,28)	(4,16)
Unibanco Equity Hedge FI Multimercado	M.M.	9.652.699,56	1,19	5,78	163,72	67,14	172,22	68,91		
TOTAL		54.615.312,83								

HSBC										
Hsbc FI Referenciado DI Crédito Privado LP Executivo	R.F.	21.884.116,22	0,83	9,01	114,89	104,63	120,86	107,37		
Hsbc FI Referenciado DI Previdenciário Regimes Próprios	R.F.	2.151,87	0,71	8,31	97,69	96,49	102,76	99,02		
Hsbc FI Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	21.290.586,03	0,77	8,78	106,10	101,96	111,60	104,64		
Hsbc FI Referenciado DI Longo Prazo Títulos Públicos	R.F.	718.324,58	0,67	8,19	92,15	95,11	96,93	97,61		
Hsbc FI Ações Top	R.V.	18.258.409,40	(0,15)	59,33	(21,05)	688,87			(0,20)	(4,57)
TOTAL		62.153.588,10								

SANTANDER										
Santander FIC FI Institucional RF	R.F.	17.402.518,69	0,70	8,63	96,97	100,20	102,00	102,83		
TOTAL		17.402.518,69								

BANCO CRUZEIRO DO SUL										
FIDC Aberto BcSul Verax CPP360	R.F.	56.520.444,72	0,76	9,27	104,64	107,62	110,07	110,45		
TOTAL		56.520.444,72								

BANCO PANAMERICANO										
Master Panamericano FIDC CDC Veículos	R.F.	64.157.900,16	0,77	9,45	106,55	109,67	112,08	112,55		
TOTAL		64.157.900,16								

SCHRODERS INVESTIMENT										
Schroder Previdenciário FI em Ações IBrX-50	R.V.	20.849.017,85	0,49	55,77	67,22	647,51			0,44	(8,13)
Schroder Brasil Long Short FI Multimercado	M.M.	11.931.199,92	0,72	10,22	98,90	118,66	104,03	121,78		
TOTAL		32.780.217,77								

TOTAL GERAL DA CARTEIRA 887.831.868,81 DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/10/2009

POSIÇÃO POR SEGMENTO - OUTUBRO DE 2009			RENDIMENTO
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	NO MÊS
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	413.641.774,16	46,52%	2.629.683,18
FUNDOS RENDA FIXA	335.063.488,23	37,68%	2.520.218,37
FUNDOS RENDA VARIÁVEL	115.387.397,43	12,98%	-103.715,51
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	23.739.208,99	2,67%	206.744,34
CONTA CORRENTE	1.308.953,07	0,15%	
TOTAIS	889.140.821,88	100,00%	5.252.930,38

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 - OUTUBRO DE 2009						
INSTITUIÇÃO	FUNDO	CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS	
BANCO DO BRASIL	371.303.436,45	1.302.657,33	372.606.093,78	41,91%	4	
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	141.319.561,47	1.256,28	141.320.817,75	15,89%	4	
BRDESCO	87.578.888,62	911,87	87.579.800,49	9,85%	4	
ITAU / UNIBANCO	54.615.312,83	57,21	54.615.370,04	6,14%	3	
H S B C	62.153.588,10	4.018,93	62.157.607,03	6,99%	5	
SANTANDER	17.402.518,69	51,45	17.402.570,14	1,96%	1	
BANCO CRUZEIRO DO SUL	56.520.444,72		56.520.444,72	6,36%	1	
BANCO PANAMERICANO	64.157.900,16		64.157.900,16	7,22%	1	
SCHRODER INVESTIMENT	32.780.217,77		32.780.217,77	3,69%	2	
T O T A I S	887.831.868,81	1.308.953,07	889.140.821,88	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 outubro de 2009, os índices para atingimento das metas, atuarial e gerencial, são os seguintes:

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	ÍNDICE	OUT/09	2009	ÍNDICE	OUT/09	2009
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6%	0,73	8,61	C.D.I.	0,69	8,39
RENDA FIXA	INPC(IBGE) + 6%	0,73	8,61	C.D.I.	0,69	8,39
RENDA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6%	0,73	8,61	IBOVESPA	0,04	63,90
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6%	0,73	8,61	C.D.I.	0,69	8,39