

RELATORIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - SETEMBRO DE 2009

ALOCÇÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO	SEG- MENTO	VALOR R\$	RENDIMENTO DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
					META ATUARIAL		META GERENCIAL			
					INPC + 6%a.a.		CDI		IBOVESPA	
					0,65	7,83	0,69	7,65	8,90	63,83
			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.	275.282.983,35								
Brasil LTN (PRE)	R.F.	5.453.114,84	0,67	7,56	103,60	96,57	96,89	98,85		
Brasil Regime Próprio Arrojado FI Referenciado DI	R.F.	52.642.115,11	0,69	7,68	106,85	98,13	99,92	100,45		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	27.975.255,32	8,73	55,57	1.349,74	709,87			98,05	87,07
Brasil Ações IBrX Indexado FIC FI	R.V.	8.788.782,45	9,80	50,19	1.514,79	641,07			110,04	78,63
TOTAL		370.142.251,07								

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Caixa NTN-B (POS)	R.F.	121.070.931,07	0,75	15,03	115,97	191,98	108,46	196,52		
Caixa FI Brasil Títulos Públicos RF	R.F.	9.360.863,67	0,67	7,90	103,23	100,87	96,54	103,25		
Caixa FI em Ações Ibovespa Ativo	R.V.	2.834.909,84	8,71	57,22	1.346,78	730,84			97,83	89,64
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	7.333.517,12	9,45	53,30	1.461,68	680,80			106,18	83,50
TOTAL		140.600.221,70								

BRASESCO

Bradesco FI RF Maxi Poder Público	R.F.	52.751.425,49	0,65	7,68	100,20	98,14	93,71	100,46		
Bradesco FI Referenciado DI Premium	R.F.	17.355.011,90	0,73	8,10	113,24	103,50	105,90	105,94		
Bradesco FIC FI em Ações Ibovespa Indexado	R.V.	14.362.512,41	8,54	58,81	1.320,66	751,14			95,94	92,13
Bradesco FIC FI Multimercado Golden Profit Moderado	M.M.	2.147.213,08	1,99	12,44	308,15	158,93	288,18	162,68		
TOTAL		86.616.162,88								

ITAU / UNIBANCO

Unibanco Institucional DI FI Referenciado	R.F.	29.862.308,03	0,71	7,83	109,06	100,00	101,99	102,37		
Unibanco Private Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	14.917.565,72	8,62	60,11	1.332,41	767,82			96,79	94,18
Unibanco Equity Hedge FI Multimercado	M.M.	9.539.196,57	(0,20)	4,54	(31,45)	57,98	(29,42)	59,34		
TOTAL		54.319.070,32								

H S B C

Hsbc FI Referenciado DI Crédito Privado LP Executivo	R.F.	21.702.897,71	0,82	8,11	126,31	103,57	118,13	106,01		
Hsbc FI Referenciado DI Previdenciário Regimes Próprios	R.F.	2.136,61	0,70	7,54	108,24	96,31	101,23	98,59		
Hsbc FI Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	21.127.676,03	0,78	7,95	120,40	101,54	112,59	103,94		
Hsbc FI Ações Top	R.V.	17.622.910,01	8,59	59,57	1.328,81	760,95			96,53	93,33
TOTAL		60.455.620,36								

SANTANDER

Santander FI Institucional RF	R.F.	17.280.732,66	0,59	7,87	91,06	100,52	85,15	102,89		
TOTAL		17.280.732,66								

BANCO CRUZEIRO DO SUL

FIDC Aberto BcSul Verax CPP360	R.F.	56.093.855,14	0,76	8,44	117,68	107,86	110,05	110,41		
TOTAL		56.093.855,14								

BANCO PANAMERICANO

Master Panamericano FIDC CDC Veículos	R.F.	63.664.899,85	0,77	8,60	119,82	109,91	112,06	112,50		
TOTAL		63.664.899,85								

SCHRODER INVESTIMENT

Schroder Previdenciário FI em Ações IBrX-50	R.V.	20.747.660,07	9,74	55,01	1.506,04	702,65			109,40	86,18
Schroder Brasil Long Short FI Multimercado	M.M.	11.846.055,00	1,42	9,43	220,25	120,49	205,98	123,34		
TOTAL		32.593.715,07								

TOTAL GERAL DA CARTEIRA 881.766.529,05 DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/09/2009

POSIÇÃO POR SEGMENTO - SETEMBRO DE 2009			RENDIMENTO NO MÊS
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	401.807.029,26	45,51%	2.963.298,71
FUNDOS RENDA FIXA	341.843.922,20	38,71%	2.451.486,78
FUNDOS RENDA VARIÁVEL	114.583.112,94	12,98%	7.634.444,12
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	23.532.464,65	2,67%	188.871,31
CONTA CORRENTE	1.218.360,21	0,14%	
TOTAIS	882.984.889,26	100,00%	13.238.100,92

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 2009					
INSTITUIÇÃO	FUNDO	CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL	370.142.251,07	1.209.063,91	371.351.314,98	42,06%	4
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	140.600.221,70	1.256,28	140.601.477,98	15,92%	4
BRDESCO	86.616.162,88	3.912,42	86.620.075,30	9,81%	4
ITAU / UNIBANCO	54.319.070,32	57,21	54.319.127,53	6,15%	3
H S B C	60.455.620,36	4.018,94	60.459.639,30	6,85%	4
SANTANDER	17.280.732,66	51,45	17.280.784,11	1,96%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL	56.093.855,14		56.093.855,14	6,35%	1
BANCO PANAMERICANO	63.664.899,85		63.664.899,85	7,21%	1
SCHRODER INVESTIMENT	32.593.715,07		32.593.715,07	3,69%	2
T O T A I S	881.766.529,05	1.218.360,21	882.984.889,26	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	SET/09	2009	ÍNDICE	SET/09	2009
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6%	0,65	7,83	C.D.I.	0,69	7,65
RENTA FIXA	INPC(IBGE) + 6%	0,65	7,83	C.D.I.	0,69	7,65
RENTA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6%	0,65	7,83	IBOVESPA	8,90	63,83
RENTA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6%	0,65	7,83	C.D.I.	0,69	7,65