

RELATORIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - FEVEREIRO DE 2010

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO	SEGMENTO	VALOR R\$	RENDIMENTO DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
					META ATUARIAL		META GERENCIAL			
					INPC + 6%a.a.		CDI		IBOVESPA (*)	
					1,19	2,57	0,59	1,25	1,68	-3,04
NO MÊS	NO ANO 2010	NO MÊS	NO ANO 2010	NO MÊS	NO ANO 2010	NO MÊS	NO ANO 2010			

BANCO DO BRASIL

Carteira Administrada - Brasil LFT (POS)	R.F.	287.572.482,84	0,58	1,23	48,87	47,94	97,89	98,06		
Carteira Administrada - Brasil LTN (PRE)	R.F.	2.611.870,67								
Brasil Regime Próprio Arrojado FI Referenciado DI	R.F.	33.099.812,24	0,89	1,57	74,89	61,27	149,99	125,35		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	35.078.071,33	1,46	(3,44)	122,80	(134,01)			(0,23)	(0,40)
Brasil Ações IBrX Indexado FIC FI	R.V.	9.273.342,26	1,04	(3,74)	87,70	(145,73)			(0,64)	(0,70)
TOTAL		367.635.579,34								

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Carteira Administrada - Caixa NTN-B (POS)	R.F.	132.781.254,72	1,52	2,62	128,08	102,11	256,54	208,88		
Caixa FI Brasil Títulos Públicos RF	R.F.	4.091.505,85	0,66	1,44	55,29	56,10	110,74	114,76		
Caixa FI em Ações Ibovespa Ativo	R.V.	4.126.845,19	1,75	(3,17)	147,57	(123,41)			0,07	(0,13)
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	17.087.700,93	1,41	(3,26)	118,80	(127,09)			(0,27)	(0,22)
TOTAL		158.087.306,69								

BRADERCO

Bradesco FI RF Maxi Poder Público	R.F.	54.530.171,73	0,62	1,30	52,37	50,83	104,89	103,99		
Bradesco FI Referenciado DI Premium	R.F.	18.285.062,98	0,59	1,25	49,58	48,80	99,32	99,82		
Bradesco FIC FI em Ações Ibovespa Indexado	R.V.	17.438.570,77	1,41	(3,65)	119,12	(142,23)			(0,27)	(0,61)
Bradesco FIC FI Multimercado Golden Profit Moderado	M.M.	2.215.644,32	0,63	(0,03)	53,43	(1,26)	107,02	(2,57)		
TOTAL		92.469.449,80								

ITAU / UNIBANCO

Unibanco Institucional DI FI Referenciado	R.F.	30.904.606,79	0,60	1,28	50,62	49,96	101,40	102,19		
Unibanco Private Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	2.930.457,34	1,50	(3,46)	126,65	(134,98)			(0,18)	(0,42)
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	18.855.942,83	1,10	(1,54)	92,79	(59,96)				
Unibanco Equity Hedge FI Multimercado	M.M.	4.848,23	0,45	1,92	38,24	74,88	76,58	153,17		
TOTAL		52.695.855,19								

HSBC

Hsbc FI Referenciado DI Crédito Privado LP Executivo	R.F.	22.483.799,94	0,61	1,28	51,17	50,04	102,48	102,36		
Hsbc FI Referenciado DI Previdenciário Regimes Próprios	R.F.	2.208,10	0,59	1,24	49,49	48,22	99,12	98,64		
Hsbc FI Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	21.866.390,47	0,60	1,28	50,67	49,75	101,49	101,76		
Hsbc FI Referenciado DI Longo Prazo Títulos Públicos	R.F.	736.854,35	0,57	1,22	48,22	47,46	96,58	97,08		
Hsbc FI Ações Top	R.V.	28.201.383,88	1,55	(3,32)	130,73	(129,33)			(0,13)	(0,28)
TOTAL		73.290.636,74								

SANTANDER

Santander FIC FI Institucional RF	R.F.	17.857.582,58	0,56	1,25	47,32	48,81	94,78	99,85		
TOTAL		17.857.582,58								

BANCO CRUZEIRO DO SUL

FIDC Aberto BcSul Verax CPP360	R.F.	58.176.192,24	0,65	1,38	54,94	53,81	110,04	110,07		
TOTAL		58.176.192,24								

BANCO PANAMERICANO

Master Panamericano FIDC CDC Veículos	R.F.	66.072.055,93	0,66	1,41	55,94	54,79	112,05	112,09		
TOTAL		66.072.055,93								

SCHRODERS INVESTIMENT

Schroder Previdenciário FI em Ações IBrX-50	R.V.	30.548.247,10	1,17	(3,15)	98,53	(122,72)			(0,51)	(0,11)
Schroder Brasil Long Short FI Multimercado	M.M.	12.182.938,65	(0,17)	0,88	(14,63)	34,34	(29,31)	70,26		
TOTAL		42.731.185,75								

GWI

GWI Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.467.736,45	(1,17)	(4,11)	(98,99)	(160,08)			(2,86)	(1,07)
TOTAL		1.467.736,45								

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.

BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.493.015,72	1,00	(3,09)	84,05	(120,39)			(0,69)	(0,05)
TOTAL		2.493.015,72								

TOTAL GERAL DA CARTEIRA

932.976.596,43

DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 26/02/2010

POSIÇÃO POR SEGMENTO - FEVEREIRO DE 2010			RENDIMENTO
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	LÍQUIDO NO MÊS
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	422.965.608,23	45,24%	3.766.521,53
FUNDOS RENDA FIXA	328.106.243,20	35,10%	2.105.758,31
FUNDOS RENDA VARIÁVEL	167.501.313,80	17,92%	1.768.044,53
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	14.403.431,20	1,54%	-49.058,51
CONTA CORRENTE	1.925.385,44	0,21%	
TOTAIS	934.901.981,87	100,00%	7.591.265,86

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 - FEVEREIRO DE 2010					
INSTITUIÇÃO	FUNDO	CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL	367.635.579,34	1.914.953,46	369.550.532,80	39,53%	4
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	158.087.306,69	1.256,28	158.088.562,97	16,91%	4
BRADESCO	92.469.449,80	5.061,61	92.474.511,41	9,89%	4
ITAU / UNIBANCO	52.695.855,19	43,71	52.695.898,90	5,64%	3
H S B C	73.290.636,74	4.018,93	73.294.655,67	7,84%	5
SANTANDER	17.857.582,58	51,45	17.857.634,03	1,91%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL	58.176.192,24		58.176.192,24	6,22%	1
BANCO PANAMERICANO	66.072.055,93		66.072.055,93	7,07%	1
SCHRODER INVESTMENT	42.731.185,75		42.731.185,75	4,57%	2
GWI	1.467.736,45		1.467.736,45	0,16%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.493.015,72		2.493.015,72	0,27%	1
TOTAIS	932.976.596,43	1.925.385,44	934.901.981,87	100,00%	27

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 26 (vinte e seis) Fundos de Investimentos, sendo estes últimos distribuídos em 12 (doze) fundos de renda fixa, 11 (dez) fundos de renda variável e 03 (três) fundos multimercado.

Em fevereiro de 2010, os índices para atingimento das metas, atuarial e gerencial, são os seguintes:

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	ÍNDICE	FEV/10	2010	ÍNDICE	FEV/10	2010
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6%	1,19	2,57	C.D.I.	0,59	1,25
RENDA FIXA	INPC(IBGE) + 6%	1,19	2,57	C.D.I.	0,59	1,25
RENDA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6%	1,19	2,57	IBOVESPA	1,68	-3,04
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6%	1,19	2,57	C.D.I.	0,59	1,25