

RELATORIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - SETEMBRO DE 2010

ALOCÇÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO	SEGMENTO	VALOR R\$	RENDIMENTO DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
					META ATUARIAL		META GERENCIAL			
					INPC + 6%a.a.		CDI		IBOVESPA (*)	
					1,03	8,27	0,84	7,00	6,58	1,23
			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)		105.945.934,17								
Carteira Administrada - Brasil LTN (PRE)	R.F.	2.770.546,62	0,64	7,36	62,59	89,06	76,07	105,12		
Carteira Administrada - Brasil NTN-B (POS)		199.239.575,50								
BB RPPS Atuarial Moderado FI Renda Fixa Previdenciário	R.F.	43.848.270,97	0,50	9,12	48,38	110,32	58,80	130,22		
FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F. - CAESB	R.F.	20.938.444,78	1,13	4,69	110,46	56,76	134,26	67,00		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	35.661.810,01	6,35	-1,83	618,33	-22,15			-0,23	-3,06
Brasil Ações IBRX Indexado FIC FI	R.V.	9.397.817,84	6,54	-2,45	637,12	-29,60			-0,03	-3,67
TOTAL		417.802.399,89								

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Carteira Administrada - Caixa NTN-B (POS)	R.F.	137.714.348,42	0,56	9,67	54,89	116,99	66,71	138,09		
Caixa FI Novo Brasil RF Crédito Privado LP	R.F.	8.672.838,57	0,71	9,75	69,02	117,98	83,89	139,26		
Caixa FI em Ações Ibovespa Ativo	R.V.	4.240.781,48	6,25	-0,49	608,67	-5,96			-0,33	-1,72
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	17.488.361,35	6,94	-0,99	675,94	-12,01			0,36	-2,22
TOTAL		168.116.329,82								

BRANCO

Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	75.496.510,42	0,51	10,89	50,07	131,69	60,86	155,44		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	32.513.000,60	0,65	9,06	63,29	109,65	76,93	129,43		
Bradesco FIC FI em Ações Ibovespa Indexado	R.V.	17.768.984,45	6,22	-1,82	605,70	-22,06			-0,36	-3,05
Bradesco FIC FI Multimercado Golden Profit Moderado	M.M.	2.300.527,61	1,81	3,80	176,73	45,94	214,82	54,22		
TOTAL		128.079.023,08								

ITAU UNIBANCO

Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	42.187.160,86	0,48	10,54	46,75	127,48	56,83	150,47		
Unibanco Private Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	3.003.994,33	6,31	-1,04	614,43	-12,59			-0,27	-2,27
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	22.041.906,06	6,88	7,60	669,83	91,98			0,30	6,38
Unibanco Equity Hedge FI Multimercado	M.M.	5.128,83	1,00	7,82	97,15	94,60	118,09	111,66		
TOTAL		67.238.190,08								

HSBC

Hsbc FI Renda Fixa Ativo Regimes Próprios	R.F.	37.235.759,68	0,55	6,81	53,17	82,34	64,63	97,19		
Hsbc FI Ações Top	R.V.	29.062.490,19	6,37	-0,37	620,07	-4,43			-0,21	-1,59
Hsbc FI Ações Setorial Ativo	R.V.	3.357.801,03	6,82	6,87	664,68	83,13			0,25	5,65
TOTAL		69.656.050,90								

SANTANDER

Santander FIC FI Renda Fixa IMA-B Títulos Públicos	R.F.	24.143.639,24	0,52	10,38	50,47	125,58	61,35	148,23		
TOTAL		24.143.639,24								

BANCO PANAMERICANO

Master Panamericano FIDC CDC Veículos	R.F.	86.921.615,89	0,95	7,88	92,18	95,27	112,04	112,45		
TOTAL		86.921.615,89								

SCHRODERS INVESTMENT

Schroder Previdenciário FI em Ações IBRX-50	R.V.	43.249.525,01	6,74	-1,77	656,82	-21,40			0,17	-3,00
TOTAL		43.249.525,01								

GWI

GWI Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.587.786,76	3,73	3,74	363,64	45,19			-2,84	2,51
TOTAL		1.587.786,76								

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.

BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.596.444,10	6,35	0,93	618,74	11,27			-0,22	-0,30
TOTAL		2.596.444,10								

TOTAL GERAL DA CARTEIRA

1.009.391.004,77

DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/09/2010

POSIÇÃO POR SEGMENTO - SETEMBRO DE 2010			RENDIMENTO
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	LÍQUIDO NO MÊS
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	445.670.404,71	43,95%	2.763.408,72
FUNDOS RENDA FIXA	371.957.241,01	36,68%	2.447.122,13
FUNDOS RENDA VARIÁVEL	189.457.702,61	18,68%	11.626.130,42
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	2.305.656,44	0,23%	41.052,61
CONTA CORRENTE	4.636.796,43	0,46%	
T O T A I S	1.014.027.801,20	100,00%	16.877.713,88

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 2010					
INSTITUIÇÃO	FUNDO	CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL	417.802.399,89	4.431.337,84	422.233.737,73	41,64%	5
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	168.116.329,82	2.386,38	168.118.716,20	16,58%	4
BRADESCO	128.079.023,08	198.973,72	128.277.996,80	12,65%	4
ITAU UNIBANCO	67.238.190,08	28,11	67.238.218,19	6,63%	4
H S B C	69.656.050,90	4.018,93	69.660.069,83	6,87%	3
SANTANDER	24.143.639,24	51,45	24.143.690,69	2,38%	1
BANCO PANAMERICANO	86.921.615,89		86.921.615,89	8,57%	1
SCHRODER INVESTMENT	43.249.525,01		43.249.525,01	4,27%	1
GW	1.587.786,76		1.587.786,76	0,16%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.596.444,10	0,00	2.596.444,10	0,26%	1
T O T A I S	1.009.391.004,77	4.636.796,43	1.014.027.801,20	100,00%	25

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

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	ÍNDICE	SET/10	2010	ÍNDICE	SET/10	2010
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6%	1,03	8,27	C.D.I.	0,84	7,00
RENDA FIXA	INPC(IBGE) + 6%	1,03	8,27	C.D.I.	0,84	7,00
RENDA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6%	1,03	8,27	IBOVESPA	6,58	1,23
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6%	1,03	8,27	C.D.I.	0,84	7,00

A Amapá Previdência, seguindo as diretrizes estabelecidas em sua Política de Investimentos e a Resolução nº 3790/2009 do Conselho Monetário Nacional, aplicou seus recursos de maneira diversificada em setembro de 2010, distribuídos em 02 (duas) Carteira de Administradas de Títulos Públicos Federais e 23 (vinte e três) Fundos de Investimentos, sendo estes últimos distribuídos em 09 (nove) fundos de renda fixa, 12 (doze) fundos de renda variável e 02 (dois) fundos multimercado.